

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月30日	1月31日	2月3日	2月4日
加重平均金利	▲0.032	▲0.039	▲0.033	▲0.023
東京レポレート(ON)	▲0.132	▲0.093	▲0.064	▲0.073
無コール残	91,503	87,794	91,668	87,874
ON	62,788	61,309	63,143	58,249
その他	28,715	26,485	28,525	29,625
有コール残	17,356	17,883	20,033	19,711

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

2月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30 【挨拶】政井審議委員 (奈良)	-	0:00 (米)1月ISM非製造業 景況指数	55.0
- 【記者会見】 若田部副総裁(2月5日)	-	22:30 (米)新規失業保険 申請件数[前週分]	-
-	-	(米)ダラス連銀総裁の 講演	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.065	0.001	▲0.015	▲0.091
T/N	-	-	▲0.005	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.083
2W	-	-	-	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.085
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.107
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.159

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%の出合から始まった。その後は主に▲0.035%~▲0.005%の水準で取引された。日銀当座預金の基礎残高・マクロ加算残高の調整を目的とした強い調達ニーズに、試取りの動きが加わり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.008%の▲0.015%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.065 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は底堅く、出合の水準は本日と同程度と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月5日	2月6日	2月7日
券	+600	▲300	+0
財政	▲21,700	+500	▲7,000
過不足	▲21,100	+200	▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	▲100	▲200	
CP等買入	+400		
国債補完供給			
当座預金増減	▲13,300	+0	▲7,000
当座預金残高	3,911,500	3,911,500	3,904,500
準備預金残高	3,390,900	主な需給要因	
積み終了先	3,390,500		
超過準備	3,390,500		
非準備先残高	520,600		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	67.7%		
乖離率	32.2%		

2月5日のオペ結果 [％][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(2/5~2/6)	3	3	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
2月4日時点 5,062,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,236,300
2月6日以降の残り所要	
積数	2,900
平均	300

国庫短期証券入札予定

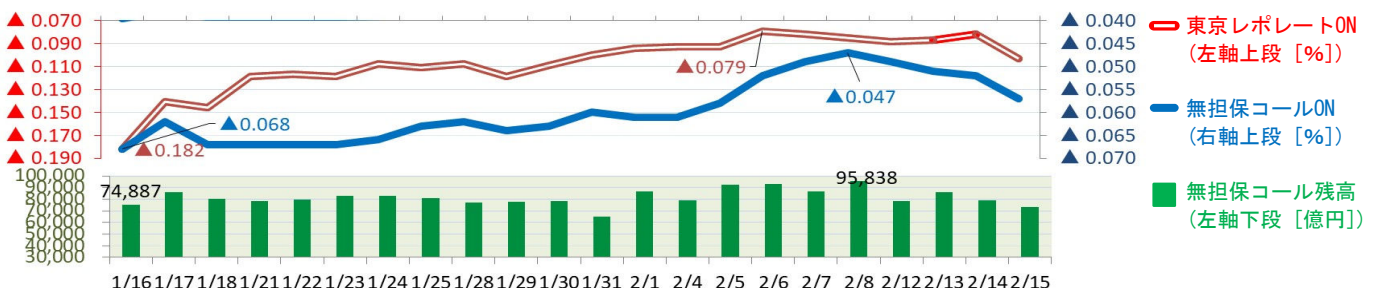
2月6日	6ヶ月	第886回
2月7日	3ヶ月	第887回
2月14日	3ヶ月	
2月19日	1年	
国債入札予定		
2月6日	30年	
2月12日	物価連動	
2月18日	5年	
2月20日	20年	

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	1月29日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200	7 13 21 27	1月29日	4
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 13 21 27	1月29日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 13 21 27	1月29日	4
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,000	10 25	1月23日	2
25年超	0~500 程度	300	月2回程度	1月23日	2
物価連動債	300 程度	300	月1回	12月9日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

1年前の市場推移 ○2019年1月積み期 [1月16日~2月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。