

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年2月6日(木)

短期市場の推移

	1月31日	2月3日	2月4日	2月5日
加重平均金利	▲0.039	▲0.033	▲0.023	▲0.015
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.064	▲0.073	▲0.091
無コール残	87,794	91,668	87,874	89,297
ON	61,309	63,143	58,249	60,217
その他	26,485	28,525	29,625	29,080
有コール残	17,883	20,033	19,711	19,563

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7日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 マネタリーベースと日本銀行の取引(1月)	-	22:30 (米)1月非農業部門雇用者数	15.3万人
15:00 コール市場残高(1月)	-	22:30 (米)1月平均時給[前年比]	3.0%
- 【記者会見】政審審議委員(2月6日)	-	-	-

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	▲0.080	0.001	▲0.016	▲0.086
T/N	-	-	▲0.005	▲0.090
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.084
2W	-	-	-	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.086
1M	-	-	▲0.003	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲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▲0.03%~▲0.005%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.030 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は底堅く、週末3日積みとなることで、出合の水準は本日よりも上昇する見込み。

資金需給

	日銀速報 2月6日	日銀予想 2月7日	当社需給予想 2月10日
券	▲300	+400	+1,000
財政	+800	▲10,400	▲4,000
過不足	+500	▲10,000	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			▲7,000
CP等買入	▲200	▲100	
国債補完供給	▲200	+200	
当座預金増減	+100	▲9,900	▲10,000
当座預金残高	3,911,600	3,901,700	3,891,700
準備預金残高	3,388,700	主な需給要因	
積み終了先	3,388,200	国債発行(30年)	
超過準備	3,388,200	国庫短期証券発行・償還(3M・6M)	
非準備先残高	522,900		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	71.0%		
乖離率	28.9%		

2月6日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(2/6~2/7)	184	184	▲0.350	▲0.350		

国庫短期証券入札予定

2月7日	3ヶ月	第887回
2月14日	3ヶ月	
2月19日	1年	
2月21日	3ヶ月	
2月12日	物価連動	
2月18日	5年	
2月20日	20年	
2月28日	2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			

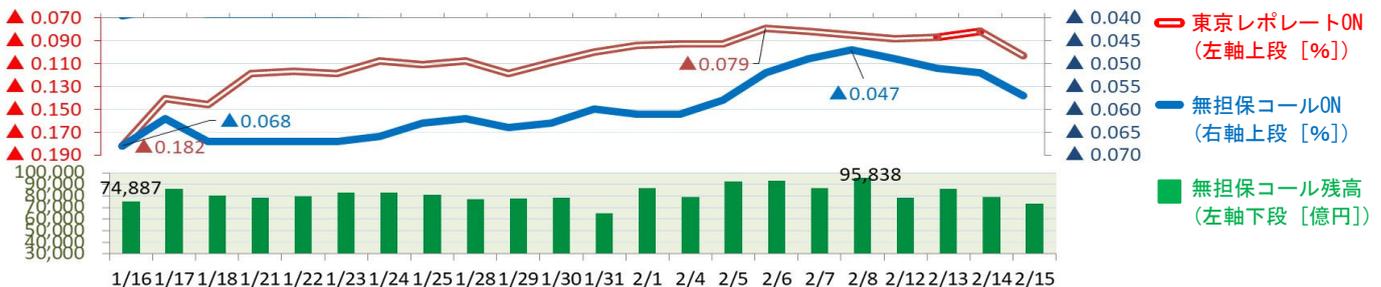
マネタリーベース [億円]
2月5日時点 5,048,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,236,300
2月7日以降の残り所要
積数 2,400
平均 300

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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会