

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月28日	1月29日	1月30日	1月31日
加重平均金利	▲0.062	▲0.064	▲0.063	▲0.060
東京レポレート(ON)	▲0.108	▲0.119	▲0.109	▲0.100
無コール残	77,083	77,778	78,609	65,010
ON	44,413	45,718	46,349	35,115
その他	32,670	32,060	32,260	29,895
有コール残	24,928	18,187	21,147	33,174

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4日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マナターベース(1月)	-	19:00 (欧)12月生産者物価指数 [前年比]	-
10:00	営業毎旬報告 (1月31日現在)	-	-	-
17:00頃	日本銀行が保有する 国債の銘柄別残高	-	-	-

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	▲0.086	0.001	▲0.061	▲0.094
T/N	-	-	▲0.020	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.022	▲0.020	▲0.022	▲0.101
2W	-	-	▲0.043	▲0.106
3W	-	-	0.000	▲0.118
1M	▲0.013	0.200	▲0.003	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.166
6M	-	-	-	▲0.161
1Y	-	-	-	▲0.161

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▲0.08%の出合から始まった。その後は主に、▲0.086%~▲0.025%の水準で出合が見られた。月末に調達を控えたビッドが戻ったことで、昨日対比取引量は増加した。同加重平均金利は前営業日対比▲0.001%の▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

税揚げ日にあたることから、ビッドサイドは地銀業態を中心に徐々に厚くなるもの予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 2月1日	日銀予想 2月4日	当社需給予想 2月5日
券	+400	+1,100	+1,000
財政	▲28,100	▲80,100	+3,000
過不足	▲27,700	▲79,000	+4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)		▲1,700	+700
CP等買入	▲100	▲100	
国債補完供給	+200		
当座預金増減	▲27,600	▲80,100	+4,000
当座預金残高	3,859,600	3,779,500	3,783,500
準備預金残高	3,380,900	主な需給要因	
積み終了先	3,380,700		
超過準備	3,380,400		
非準備預金残高	478,700		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	61.3%		
乖離率	38.6%		

2月1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	接分
国債補完供給(2/1~2/4)	23,745	4	4	▲0.600	▲0.600	
	10,000	1	1	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(2/4~2/18)	8,000	706	706			

マナターベース [億円]
1月31日時点 5,003,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,134,800
2月4日以降の残り所要
積数 2,000
平均 200

国庫短期証券入札予定

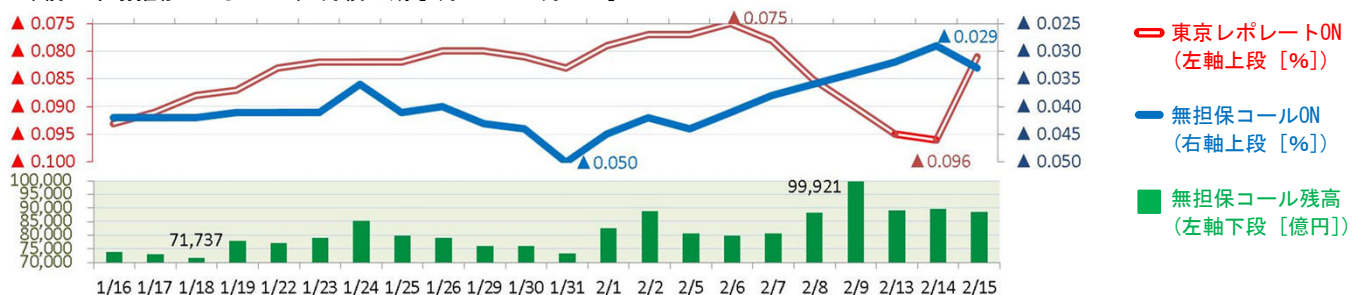
2月7日	6ヶ月	第812回
2月8日	3ヶ月	第813回
2月15日	3ヶ月	
2月19日	1年	
2月5日	10年	
2月7日	30年	
2月13日	5年	
2月15日	物価連動	

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30日	2
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	4 8 18 27	1月28日	4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	6 8 14 22 27	1月30日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	500	4 12 18 22	1月28日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	1月25日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	12月17日	1

1年前の市場推移 ○2018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。