

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年2月4日(月)

## 短期市場の推移

	1月29日	1月30日	1月31日	2月1日
加重平均金利	▲0.064	▲0.063	▲0.060	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.119	▲0.109	▲0.100	▲0.094
無コール残	77,778	78,609	65,010	86,392
ON	45,718	46,349	35,115	56,157
その他	32,060	32,260	29,895	30,235
有コール残	18,187	21,147	33,174	30,000

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)1月のISM非製造業指数	-
-	-	19:00 (欧)12月小売売上高 [前月比]	0.2%
-	-	-	-

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	▲0.093
T/N	-	-	▲0.020	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.001	▲0.016	▲0.099
2W	▲0.040	▲0.020	▲0.031	▲0.107
3W	-	-	-	▲0.119
1M	-	-	-	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.165
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、▲0.080%~▲0.025%の水準で出合が見られた。同加重平均金利は前営業日対比横ばいの▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.015

## 翌営業日のマーケット

地銀業態を中心にビッドサイドがやや厚くなり、出合のレンジは小幅上昇と予想する。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月4日	2月5日	2月6日
券	+1,000	+600	+0
財政	▲76,200	▲300	▲22,000
過不足	▲75,200	+300	▲22,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+10,600	
共通担保(全店)	▲1,700	+700	
CP等買入	▲100	▲100	
国債補完供給	▲200	+200	
当座預金増減	▲76,500	+11,000	▲22,000
当座預金残高	3,783,100	3,794,100	3,772,100
準備預金残高	3,305,500	主な需給要因	
積み終了先	3,305,400		
超過準備	3,305,400		
非準備預金残高	477,600	国債発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	64.5%		
乖離率	35.4%		

## 2月4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
国債買入(2/5~)						
1~3年	3,500	9,093	3,508	0.005	0.005	99.0
3~5年	4,000	11,930	4,005	0.007	0.007	52.3
10~25年	2,000	6,567	2,009	0.006	0.007	54.8
25年~	500	1,626	504	0.006	0.007	40.1
国債補完供給(2/4~2/5)						
	95,428	19	19	▲0.600	▲0.600	
	2,511	118	118	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要
2月1日時点 4,975,200	今積期の所要準備額 3,134,800
	2月5日以降の残り所要積数 1,900
	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	
国債入札予定		
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	2月4日	3
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	2月4日	3
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	#VALUE!	

## 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。