

短期市場の推移

	1月30日	1月31日	2月1日	2月4日
加重平均金利	▲0.063	▲0.060	▲0.061	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.109	▲0.100	▲0.094	▲0.093
無コール残	78,609	65,010	86,392	79,185
ON	46,349	35,115	56,157	46,350
その他	32,260	29,895	30,235	32,835
有コール残	21,147	33,174	30,000	28,167

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
-	-	21:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
-	-	22:30 (米)11月貿易収支	-540億米ドル
-	-	-	-

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	▲0.059	▲0.093
T/N	-	-	▲0.020	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.000	▲0.009	▲0.098
2W	-	-	-	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.119
1M	-	-	▲0.035	▲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▲0.075%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。地銀業態を中心に調達意欲が昨日対比で強まり、同加重平均金利は前営業日対比+0.002%の▲0.059%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは強く、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5日	2月6日	2月6日	2月7日	2月7日	2月7日
券	+600	+600	+600	+0	+0	+0
財政	▲1,400	▲27,300	▲27,300	▲4,000	▲4,000	▲4,000
過不足	▲800	▲26,700	▲26,700	▲4,000	▲4,000	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入				+2,500		
国債買入		+10,600				
CP等買入	▲100					
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減	+9,800	▲24,100	▲24,100	▲4,000	▲4,000	▲4,000
当座預金残高	3,792,900	3,768,800	3,768,800	3,764,800	3,764,800	3,764,800
準備預金残高	3,320,300	主な需給要因				
積み終了先	3,320,200					
超過準備	3,320,200					
非準預先残高	472,600					
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(10年)				
平均	67.7%					
乖離率	32.2%					

2月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(2/6~)	2,500	11,167	2,502	0.015	0.036	45.6
米ドル資金供給(2/7~2/14)			6	2.900	2.900	
CP等買入(2/8~)	2,000	7,230	1,980	▲0.001	▲0.001	40.0
国債補完供給(2/5~2/6)	40,134	77	77	▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給用担保国債供給(2/6~2/15)	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月4日時点 4,897,700	今積期の所要準備額 3,134,800
	2月6日以降の残り所要積数 1,700
	平均 200

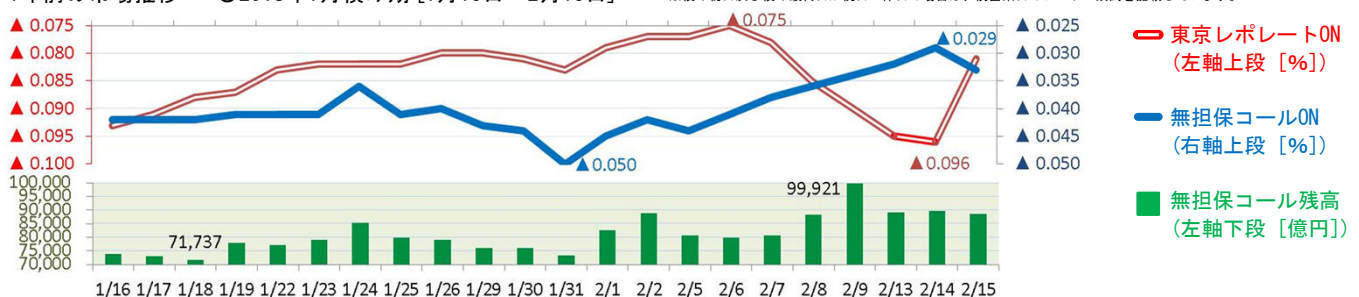
国庫短期証券入札予定

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7日	30年	
2月13日	5年	
2月15日	物価運動	
2月19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
物価運動債	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]



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。