

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年2月6日(水)

## 短期市場の推移

	1月31日	2月1日	2月4日	2月5日
加重平均金利	▲0.060	▲0.061	▲0.061	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.100	▲0.094	▲0.093	▲0.093
無コール残	65,010	86,392	79,185	92,672
ON	35,115	56,157	46,350	60,987
その他	29,895	30,235	32,835	31,685
有コール残	33,174	30,000	28,167	24,175

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
15:00	コール市場残高(1月)	-	22:30	(米)新規失業保険申請件数
	-			(米)セントリス連銀総裁講演
	-			-

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	▲0.086	0.001	▲0.052	▲0.079
T/N	-	-	▲0.020	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.037	▲0.015	▲0.028	▲0.093
2W	▲0.037	▲0.012	▲0.021	▲0.105
3W	-	-	-	▲0.116
1M	-	-	0.000	▲0.131
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
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%の出合から始まり、その後は主に▲0.080~▲0.025%の水準で出合が見られた。昨日同様、地銀業態を中心に調達意欲が高かったことに加え、一部で試し取りの動きも見られたことから、同加重平均金利は前営業日対比+0.007%の▲0.052%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070		▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.080 ~ 0.001

## 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 2月6日	日銀予想 2月7日	当社需給予想 2月8日
券	+600	▲500	+0
財政	▲27,400	+3,200	▲11,000
過不足	▲26,800	+2,700	▲11,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+2,500		
国債買入		+5,300	
CP等買入			+2,000
国債補完供給	+100		
当座預金増減	▲24,200	+8,000	▲9,000
当座預金残高	3,768,700	3,776,700	3,767,700
準備預金残高	3,302,400	主な需給要因	
積み終了先	3,302,200		
超過準備	3,302,200		
非準備先残高	466,300	国債発行(30年)	
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 [%(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(2/7~)						
~1年	500	2,282	500	0.040	0.040	
5~10年	4,300	8,599	4,309	▲0.005	▲0.004	51.7
物価連動	250	1,181	250	0.050	▲0.005	
国債補完供給(2/6~2/7)						
	19,440	24	24	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月5日時点 4,906,900	今積期の所要準備額 3,134,800
	2月7日以降の残り所要積数 1,500
	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7日	30年	
2月13日	5年	
2月15日	物価連動	
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	2月6日	1
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	2月6日 4
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	2月6日	1
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。