

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年2月7日(木)

短期市場の推移

[億円][%]

| | 2月1日 | 2月4日 | 2月5日 | 2月6日 |
|-------------|--------|--------|--------|--------|
| 加重平均金利 | ▲0.061 | ▲0.061 | ▲0.058 | ▲0.052 |
| 東京レポレート(ON) | ▲0.094 | ▲0.093 | ▲0.093 | ▲0.079 |
| 無コール残 | 86,392 | 79,185 | 92,672 | 92,872 |
| ON | 56,157 | 46,350 | 60,987 | 61,217 |
| その他 | 30,235 | 32,835 | 31,685 | 31,655 |
| 有コール残 | 30,000 | 28,167 | 24,175 | 29,525 |

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8日の予定(時刻は日本時間)

| | 日本 | 予想 | 海外 | 予想 |
|------|---------------------|--------|----|----|
| 8:50 | 12月国際収支(経常収支) | 4572億円 | - | - |
| 9:00 | 毎月勤労統計(12月)市場コンセンサス | +1.7% | - | - |
| | | | | |

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 | ▲0.051 | ▲0.082 |
| T/N | - | - | ▲0.020 | ▲0.087 |
| S/N | - | - | - | - |
| 1W | ▲0.025 | ▲0.015 | ▲0.018 | ▲0.091 |
| 2W | - | - | - | ▲0.106 |
| 3W | - | - | - | ▲0.121 |
| 1M | - | - | ▲0.005 | ▲0.133 |
| 2M | - | - | - | - |
| 3M | - | - | - | ▲0.161 |
| 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▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.070~▲0.020%の水準で出合が見られた。昨日同様、資金調達ニーズが高く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.051%となった。

| 都銀・信託 | | 証券 | 地銀 |
|-----------------|--|-----------------|-----------------|
| ▲0.070 ~ ▲0.065 | | ▲0.060 ~ ▲0.060 | ▲0.070 ~ ▲0.010 |

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは高いと予想されるため、出合のレンジは上昇すると見込まれる。

資金需給

[億円]

| | 日銀速報 2月7日 | 日銀予想 2月8日 | 当社需給予想 2月12日 |
|----------|--------------|-------------------|-----------------|
| 券 | ▲600 | ▲100 | +1,000 |
| 財政 | +3,700 | ▲9,700 | ▲3,000 |
| 過不足 | +3,100 | ▲9,800 | ▲2,000 |
| 金融調節 | エンド | スタート | エンド |
| 国債買入 | +5,300 | - | - |
| 共通担保(全店) | - | ▲200 | ▲7,000 |
| CP等買入 | - | +2,000 | - |
| ETF買入 | - | +500 | - |
| 国債補完供給 | ▲100 | +100 | - |
| 当座預金増減 | +8,300 | ▲7,400 | ▲9,000 |
| 当座預金残高 | 3,777,000 | 3,769,600 | 3,760,600 |
| 準備預金残高 | 3,314,900 | 主な需給要因 | |
| 積み終了先 | 3,314,700 | 国債発行(30年) | |
| 超過準備 | 3,314,700 | 国庫短期証券発行償還(3M・6M) | |
| 非準備預金残高 | 462,100 | 99.9% | |
| 準備預金進捗率 | 99.9% | 74.2% | |
| 平均 | 74.2% | 乖離率 25.7% | |
| 乖離率 | 25.7% | | |

2月7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(2/7~2/8) | 20,788 | 131 | 131 | ▲0.600 | ▲0.600 | |

マネタリーベース [億円]
2月6日時点 4,882,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,135,900
2月8日以降の残り所要積数 1,300
平均 200

国庫短期証券入札予定

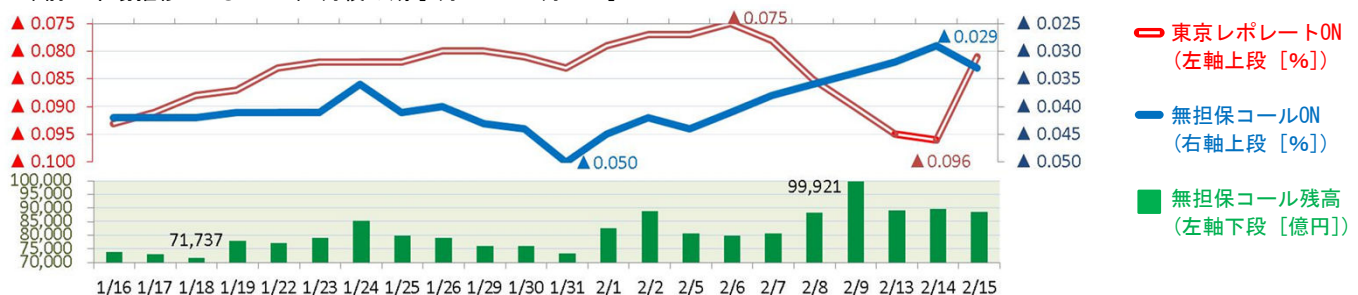
今月の国債買入オペ予定

| 2月8日 | 3ヶ月 | 第813回 | 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 |
|-------|------|-------|------------|----------------|---------|---------|------------|---------|
| 2月15日 | 3ヶ月 | | 1年以下 | 100~1,000 程度 | 500 | 月2回程度 | 2月6日 | 1 |
| 2月19日 | 1年 | | 1年超3年以下 | 2,500~4,500 程度 | 3,500 | | 2月4日 | 3 |
| 2月22日 | 3ヶ月 | | 3年超5年以下 | 3,000~5,500 程度 | 4,000 | 4 | 8 18 27 | |
| 2月13日 | 5年 | | 5年超10年以下 | 3,000~6,000 程度 | 4,300 | 6 | 8 14 22 27 | 2月6日 |
| 2月15日 | 物価運動 | | 10年超25年以下 | 1,500~2,500 程度 | 2,000 | 4 | 12 18 22 | 2月4日 |
| 2月19日 | 20年 | | 25年超 | 100~1,000 程度 | 500 | | | 3 |
| 2月28日 | 2年 | | 物価運動債 | 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。

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