

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	4
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	3
2月19日	20年		25年超	100~1,000 程度	500				
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