

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年2月13日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月6日	2月7日	2月8日	2月12日
加重平均金利	▲0.052	▲0.049	▲0.047	▲0.049
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.082	▲0.085	▲0.088
無コール残	92,872	86,758	95,838	78,572
ON	61,217	55,503	58,183	48,747
その他	31,655	31,255	37,655	29,825
有コール残	29,525	24,503	27,245	26,993

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10~12月期のGDP速報値[前期比年率]	1.4%	22:30	(米)1月生産者物価コア指数[前年比]	2.5%
	-		22:30	(米)12月の小売売上高	0.1%
	-		22:30	(米)週間の新規失業保険申請件数	-

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

本日の市況

	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	▲0.087
T/N	-	-	▲0.020	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.037	0.001	▲0.027	▲0.112
2W	-	-	▲0.020	▲0.122
3W	-	-	▲0.020	▲0.129
1M	-	-	-	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.164
6M	-	-	-	▲0.164
1Y	-	-	-	▲0.164

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

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.080~▲0.020%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.051%と2営業日連続で低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

出合レンジは本日と概ね横ばい圏で推移すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月13日	2月14日	2月14日	2月15日	2月15日	2月16日
券	+900	▲700	▲700	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲1,800	▲31,600	▲31,600	+85,000	+85,000	+85,000
過不足	▲900	▲32,300	▲32,300	+84,000	+84,000	+84,000
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				+5,000		
国債買入		+2,500		▲200		
CP等買入	▲100			▲100		
社債等買入						
ETF買入		+200				
国債補完供給		▲300		+300		
当座預金増減	+1,400	▲27,300	▲27,300	+84,000	+84,000	+84,000
当座預金残高	3,783,000	3,755,700	3,755,700	3,839,700	3,839,700	3,839,700
準備預金残高	3,337,600					
積み終了先	3,337,400					
超過準備	3,337,400					
非準備預金残高	445,400					
準備預金進捗率	99.9%		源泉税揚げ	年金定時払い		
平均	93.5%		国債発行(5年)	国債償還(2年)		
乖離率	6.4%					

2月13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
国庫短期証券買入(2/14~)	5,000	21,174	5,000	0.021	0.025	82.9
CP等買入(2/18~)	2,000	5,960	1,970	▲0.001	▲0.001	55.6
国債補完供給(2/13~2/14)	30,000	256	256	▲0.500	▲0.500	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月12日時点 4,895,200	今積期の所要準備額 3,135,900
	2月14日以降の残り所要積数 300
	平均 100

国庫短期証券入札予定

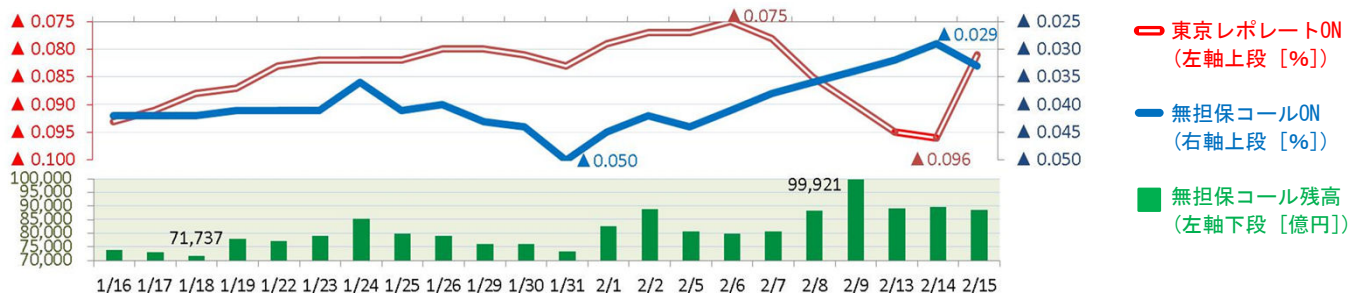
今月の国債買入オペ予定

2月15日	3ヶ月	第814回
2月19日	1年	第815回
2月22日	3ヶ月	
3月1日	3ヶ月	
国債入札予定		
2月15日	物価運動	
2月19日	20年	
2月28日	2年	
3月5日	10年	

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 6 18 27	2月8日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	6 8 14 22 27	2月8日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	4 12 18 22	2月12日	2
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	1

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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会