

短期市場の推移

	2月4日	2月5日	2月6日	2月7日
加重平均金利	▲0.061	▲0.058	▲0.052	▲0.049
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.093	▲0.079	▲0.082
無コール残	79,185	92,672	92,872	86,758
ON	46,350	60,987	61,217	55,503
その他	32,835	31,685	31,655	31,255
有コール残	28,167	24,175	29,525	24,503

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12日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック(1月)	-	(米)カンザスシティ連銀総裁講演	
	-		-	
	-		-	

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	▲0.047	▲0.085
T/N	-	-	▲0.020	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.002	▲0.016	▲0.101
2W	▲0.045	0.000	▲0.030	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.124
1M	-	-	-	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.163
6M	-	-	-	▲0.163
1Y	-	-	-	▲0.163

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▲0.060%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。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+0.002%の▲0.047%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.080 ~ ▲0.060	▲0.080 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

地銀業態を中心に資金調達ニーズは高いと予想されるため、堅調な地合となる見込み。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月8日	2月12日	2月12日	2月13日	2月13日	2月13日
券		+0	+500	+0	+0	
財政	▲10,000	▲1,500	▲1,500	▲2,000	▲2,000	
過不足	▲10,000	▲1,000	▲1,000	▲2,000	▲2,000	
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
国債買入			+12,100			
共通担保(全店)		▲7,000	+3,300			
CP等買入	▲200	+2,000	▲200			
ETF買入		+500				
国債補完供給	+100	▲100	+100			
当座預金増減	▲7,700	+7,500	▲2,000			
当座預金残高	3,769,300	3,776,800	3,774,800			
準備預金残高	3,323,200	主な需給要因				
積み終了先	3,323,200					
超過準備	3,323,000					
非準備預金残高	446,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	87.1%					
乖離率	12.8%					

2月8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(2/12~)						
1~3年	3,500	9,572	3,505	▲0.008	▲0.007	73.4
3~5年	4,000	5,267	4,002	▲0.014	▲0.010	1.7
5~10年	4,300	10,746	4,314	▲0.017	▲0.015	17.4
国債補完供給(2/8~2/12)						
	28,654	81	81	▲0.500	▲0.500	
共通担保(全店)(2/12~2/25)						
	8,000	3,325	3,325			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月7日時点 4,891,000	今積期の所要準備額 3,135,900
	2月12日以降の残り所要積数 500
	平均 100

国庫短期証券入札予定

2月15日	3ヶ月	第814回
2月19日	1年	
2月22日	3ヶ月	
3月1日	3ヶ月	
国債入札予定		
2月13日	5年	
2月15日	物価運動	
2月19日	20年	
2月28日	2年	

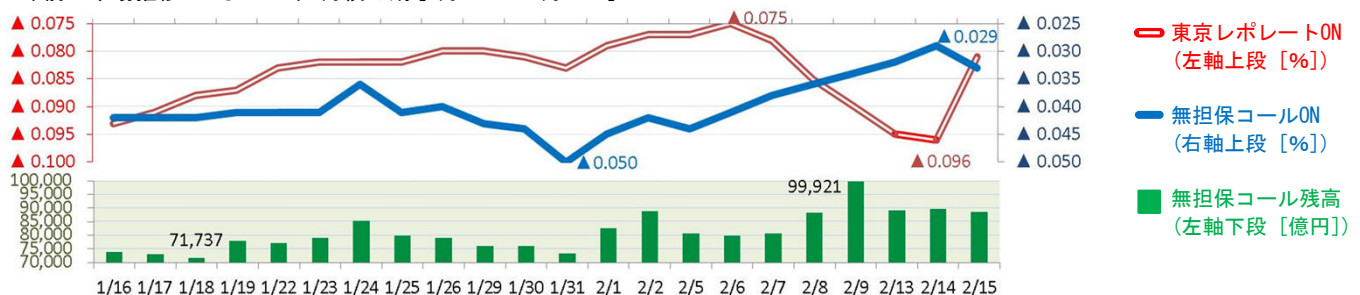
今月の国債買入オペ予定

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 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	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	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。