

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年2月14日(金)

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月7日	2月10日	2月12日	2月13日
加重平均金利	▲0.014	▲0.010	▲0.008	▲0.008
東京レポレート(ON)	▲0.062	▲0.054	▲0.077	▲0.093
無コール残	101,779	90,381	84,793	89,837
ON	65,744	53,896	57,878	63,012
その他	36,035	36,485	26,915	26,825
有コール残	19,244	19,114	18,655	18,846

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17日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	10-12月期国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	▲3.8%	(米)休場(ワシントン大統領誕生記念)	-
13:30	12月の鉱工業生産・確報(経産省)	-	(欧)ユーロ圏財務相会合(ブリュッセル)	-
17:00	業態別の日銀当座預金残高(1月)	-	-	-

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	▲0.065	0.001	▲0.011	▲0.077
T/N	-	-	-	▲0.075
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.005	▲0.009	▲0.075
2W	-	-	0.000	▲0.078
3W	-	-	0.000	▲0.083
1M	▲0.020	▲0.005	▲0.013	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.133
1Y	-	-	-	▲0.158

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▲0.005%の出合から始まった。その後は主に▲0.010%~▲0.003%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.011%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

週明けは新積み期となるため、本日よりもやや弱い地合いを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 2月14日	日銀予想 2月17日	当社需給予想 2月18日
券	+300	+500	+0
財政	+74,100	+300	▲1,000
過不足	+74,400	+800	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+12,400		
CP等買入	▲100	▲200	
ETF買入		+700	
国債補完供給	+100	+100	
当座預金増減	+86,700	+1,400	▲1,000
当座預金残高	3,998,800	4,000,200	3,999,200
準備預金残高	3,478,400		
積み終了先	3,478,400		
超過準備	3,478,200		
非準備先残高	520,400		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

2月14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	按分
国債補完供給(2/14~2/17)	85	85	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
2月13日時点 5,047,700

所要 [億円]
来積み期の所要準備額 3,026,800
2月17日以降の残高所要
積数 515,100
平均 18,400

国庫短期証券入札予定

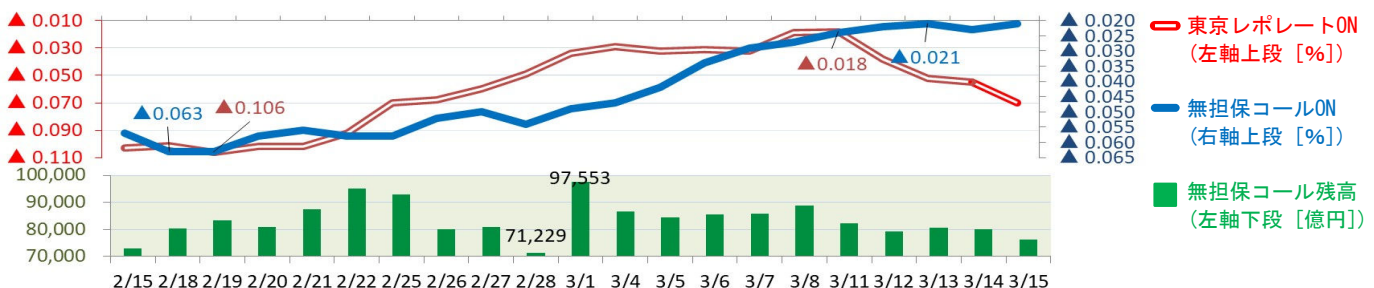
2月19日	1年	第889回
2月21日	3ヶ月	第890回
2月28日	3ヶ月	
3月6日	3ヶ月	
国債入札予定		
2月18日	5年	
2月20日	20年	
2月28日	2年	
3月3日	10年	

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10日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200	7 13 21 27	2月13日	2
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 13 21 27	2月13日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 13 21 27	2月10日	1
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	10 25	2月7日	1
25年超	0~500 程度	300	月2回程度	2月13日	0
物価連動債	300 程度	300	月1回		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

1年前の市場推移 ○2019年2月積み期 [2月15日~3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