

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年1月6日(月)

短期市場の推移

	12月25日	12月26日	12月27日	12月30日
加重平均金利	▲0.056	▲0.055	▲0.051	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.048	▲0.055	▲0.056	▲0.082
無コール残	81,346	81,072	79,941	48,716
ON	49,181	48,657	49,076	34,616
その他	32,165	32,415	30,865	14,100
有コール残	24,096	20,862	20,722	20,394

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。

1月7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース(12月)	-	22:30 (米)11月貿易収支	-490億米ドル
10:00	日銀営業毎旬報告 (12月31日現在)	-	(米)11月の製造業受注	
			(米)12月のISM 非製造業指数	

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

	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	▲0.087	0.001	▲0.061	▲0.104
T/N	-	-	-	▲0.105
S/N	-	-	-	-
1W	0.000	0.002	0.001	▲0.095
2W	▲0.020	0.000	▲0.006	▲0.093
3W	▲0.010	0.000	▲0.007	▲0.093
1M	-	-	-	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.165

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▲0.050%の出会いから始まった。その後は主に▲0.087%~▲0.040%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+0.007%となる▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	- ~ -	▲0.087 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、出合水準は横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月6日	1月7日	1月8日
券	+6,300	+5,800	+4,000
財政	▲21,000	+5,300	▲63,000
過不足	▲14,700	+11,100	▲59,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		▲9,300	
CP等買入		▲100	
国債補完供給	+900		
当座預金増減	▲13,800	+20,300	▲59,000
当座預金残高	3,991,700	4,012,000	3,953,000
準備預金残高	3,469,600	主な需給要因	
積み終了先	3,469,300	国庫短期証券発行償還(3M)	
超過準備	3,469,300	国債発行(10年)	
非準備先残高	522,100	法人税・消費税・保険揚げ	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	71.0%		
乖離率	28.9%		

1月6日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(1/7~)						
1~3年	4,200	7,223	4,204	▲0.030	▲0.026	66.3
3~5年	3,400	9,659	3,403	▲0.032	▲0.031	8.8
10~25年	1,000	5,133	1,008	▲0.030	▲0.027	15.6
25年~	300	1,301	303	▲0.034	▲0.033	54.8
国債補完供給(1/6~1/7)						
		34	34	▲0.350	▲0.350	

マネタリーベース [億円]
12月30日時点 5,182,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,226,800
1月7日以降の残り所要積数 1,900
平均 200

国庫短期証券入札予定

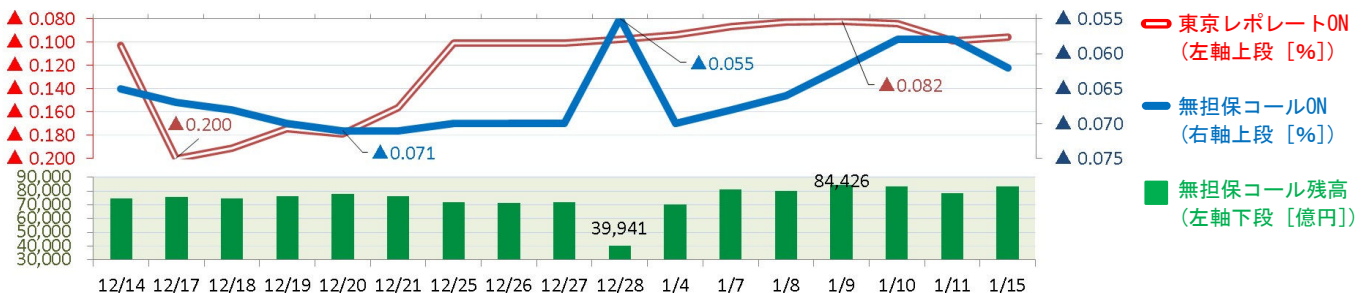
1月7日	3ヶ月	第879回
1月9日	6ヶ月	第880回
1月10日	3ヶ月	第881回
1月16日	1年	第882回
1月7日	10年	
1月9日	30年	
1月15日	5年	
1月17日	20年	

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	12月25日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	6 10 20 29	1月6日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	12月25日	4
10年超25年以下	500~1,500 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	6 14 23	1月6日	2
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	12月13日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	12月9日	-

1年前の市場推移 ○2018年12月積み期 [12月14日~1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。