

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年1月7日(火)

短期市場の推移

	12月26日	12月27日	12月30日	1月6日
加重平均金利	▲0.055	▲0.051	▲0.068	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.055	▲0.056	▲0.082	▲0.104
無コール残	81,072	79,941	48,716	67,462
ON	48,657	49,076	34,616	44,472
その他	32,415	30,865	14,100	22,990
有コール残	20,862	20,722	20,394	21,760

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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因(1月見込み)	-	22:15	(米)12月ADP全米雇用報告
				(米)週間のMBA住宅ローン申請指数

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	▲0.064	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.073
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.040	▲0.042	▲0.073
2W	▲0.040	▲0.035	▲0.039	▲0.076
3W	-	-	▲0.035	▲0.083
1M	-	-	▲0.015	▲0.089
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.145
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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出会いから始まった。その後は主に▲0.087%~▲0.035%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%となる▲0.064%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.080 ~ ▲0.065	▲0.087 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

税・保険揚げがあるものの、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7日	1月8日	1月9日
券	+5,700	+4,100	+3,000
財政	+6,000	▲55,000	+2,000
過不足	+11,700	▲50,900	+5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲100	+9,300	
CP等買入			
ETF買入			+100
国債補完供給	▲200	+200	
当座預金増減	+20,700	▲50,600	+5,000
当座預金残高	4,012,400	3,961,800	3,966,800
準備預金残高	3,491,900	主な需給要因	
積み終了先	3,491,600	国庫短期証券発行償還(3M)	
超過準備	3,491,600	国債発行(10年)	
非準備先残高	520,500	法人税・消費税・保険揚げ	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	74.2%		
乖離率	25.7%		

1月7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
米ドル資金供給(1/9~1/16)	0	0	2,050	2,050		
国債補完供給(1/7~1/8)	158	158	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
1月6日時点 5,162,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,226,800
1月8日以降の残り所要積数 1,600
平均 200

国庫短期証券入札予定

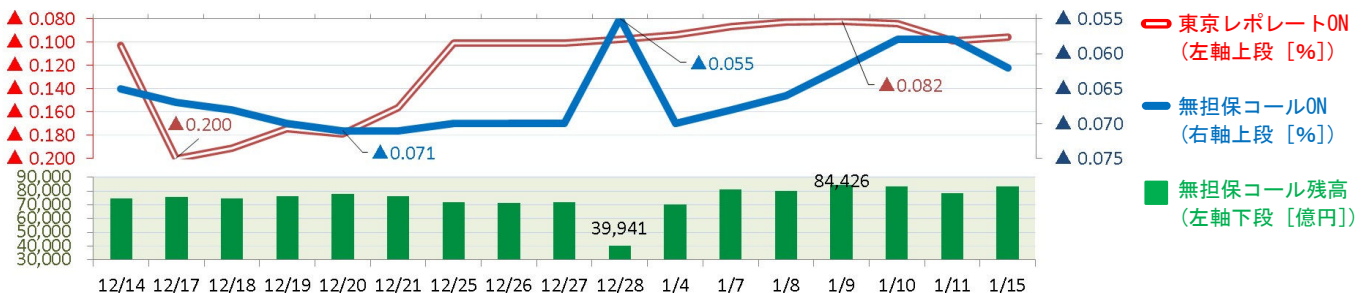
1月9日	6ヶ月	第880回
1月10日	3ヶ月	第881回
1月16日	1年	
1月17日	3ヶ月	
1月9日	30年	
1月15日	5年	
1月17日	20年	
1月28日	40年	

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。