

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年1月9日(木)

短期市場の推移

	12月30日	1月6日	1月7日	1月8日
加重平均金利	▲0.068	▲0.061	▲0.064	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.104	▲0.092	▲0.061
無コール残	48,716	67,462	76,338	77,028
ON	34,616	44,472	50,963	50,068
その他	14,100	22,990	25,375	26,960
有コール残	20,394	21,760	22,602	25,585

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10日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00頃	消費活動指数(11月)	-	22:30 (米)12月非農業部門雇用者数	16.8万人
14:00頃	景気動向指数(11月)	-	22:30 (米)12月失業率	3.5%

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	▲0.085	0.001	▲0.052	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.002	▲0.024	▲0.083
2W	▲0.005	0.000	▲0.003	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	▲0.020	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.143
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%の出会いから始まった。その後は主に▲0.065%~▲0.035%の水準で取引された。大手行を中心に資金調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.009%の▲0.052%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.060 ~ ▲0.045	▲0.065 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは強く、出合のレンジは上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月9日	1月10日	1月10日	1月11日	1月14日	1月15日
券	+2,700	+2,500	+2,500	+3,000	+3,000	+3,000
財政	+3,300	▲4,700	▲4,700	▲3,000	▲3,000	▲3,000
過不足	+6,000	▲2,200	▲2,200	+0	+0	+0
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
共通担保(全店)	▲200	▲400	▲400	▲6,000	▲6,000	▲6,000
CP等買入						
国債補完供給	▲100	+100	+100			
当座預金増減	+5,700	▲2,500	▲2,500	▲6,000	▲6,000	▲6,000
当座預金残高	3,968,800	3,966,300	3,966,300	3,960,300	3,960,300	3,960,300
準備預金残高	3,453,500					
積み終了先	3,453,200					
超過準備	3,453,200					
非準預先残高	515,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	80.6%					
乖離率	19.3%					

1月9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(1/9~1/10)	88	88	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
1月8日時点 5,123,800

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,233,900
1月10日以降の残り所要積数	1,100
平均	200

国庫短期証券入札予定

1月10日	3ヶ月	第881回
1月16日	1年	第882回
1月17日	3ヶ月	
1月24日	3ヶ月	
1月15日	5年	
1月17日	20年	
1月28日	40年	
1月30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	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。