

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年1月10日(金)

短期市場の推移

	1月6日	1月7日	1月8日	1月9日
加重平均金利	▲0.061	▲0.064	▲0.061	▲0.052
東京レポレート(ON)	▲0.104	▲0.092	▲0.061	▲0.083
無コール残	67,462	76,338	77,028	74,375
ON	44,472	50,963	50,068	46,515
その他	22,990	25,375	26,960	27,860
有コール残	21,760	22,602	25,585	20,295

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14日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	11月国際収支(経常収支)	14233億円	22:30	(米)12月消費者物価コア指数[前年比]	2.3%
8:50	貸出・預金動向(12月)	-		(米)NY連銀総裁が討論会に出席(ロンドン)	
8:50	業種別・地域別直接投資(7~9月期)	-		(米)カンザスシティ連銀総裁の講演	

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	▲0.080	0.001	▲0.035	▲0.112
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.086
2W	▲0.005	0.000	▲0.004	▲0.084
3W	-	-	0.000	▲0.087
1M	-	-	-	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.107
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▲0.040%の出合いから始まった。その後は主に▲0.045%~▲0.020%の水準で取引された。連休前の週末4日積みのため調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.017%の▲0.035%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.045	▲0.040 ~ ▲0.020	▲0.045 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

週明けも調達ニーズは底堅く、出合いの水準は横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月10日	1月14日	1月15日
券	+2,600	+3,100	+2,000
財政	▲5,100	▲400	▲11,000
過不足	▲2,500	+2,700	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+11,900	
共通担保(全店)		▲6,000	+5,900
CP等買入	▲400	▲400	
国債補完供給	+100	▲300	+300
当座預金増減	▲3,100	+14,400	▲9,000
当座預金残高	3,965,700	3,980,100	3,971,100
準備預金残高	3,442,800	主な需給要因	
積み終了先	3,442,600	国庫短期証券	国債発行(個人)
超過準備	3,442,600	発行・償還	国債償還
非準預先残高	522,900	(3M)	(2年・個人)
準備預金進捗率	99.9%		源泉税揚げ
平均	93.5%		
乖離率	6.4%		

1月10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(1/14~)						
1~3年	4,200	11,253	4,204	▲0.010	▲0.008	58.4
3~5年	3,400	11,569	3,405	▲0.002	▲0.001	18.3
5~10年	3,500	7,960	3,515	0.002	0.003	85.3
物価連動	300	1,798	302	▲0.070	▲0.103	11.5
国債補完供給(1/10~1/14)						
共通担保(全店)(1/14~1/27)		316	316	▲0.350	▲0.350	
	15,000	5,878	5,878			

マナタリーベース [億円]
1月9日時点 5,126,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,233,900
1月14日以降の残り所要積数 300
平均 100

国庫短期証券入札予定

1月16日	1年	第882回
1月17日	3ヶ月	第883回
1月24日	3ヶ月	
1月31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10日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	1月10日	3
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	1月10日	1
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。