

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年1月27日(月)

短期市場の推移

	1月21日	1月22日	1月23日	1月24日
加重平均金利	▲0.018	▲0.018	▲0.018	▲0.016
東京レポレート(ON)	▲0.070	▲0.077	▲0.074	▲0.079
無コール残	76,564	77,363	92,013	83,595
ON	50,224	50,913	65,108	55,435
その他	26,340	26,450	26,905	28,160
有コール残	18,983	18,820	19,012	19,498

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28日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 企業向けサービス価格指数(12月)	-	22:30 (米)12月耐久財受注[前月比]	1.0%
14:00 基調的なインフレ率を捕捉するための指標(12月)	-	23:00 (米)11月S&P/コアロジックCS20都市住宅価格指数[前年比]	2.45%
		FOMC(29日まで)	

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	▲0.055	0.001	▲0.019	▲0.071
T/N	-	-	-	▲0.069
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.071
2W	-	-	▲0.007	▲0.070
3W	-	-	-	▲0.074
1M	-	-	-	▲0.077
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.098
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▲0.010%の出合から始まった。その後は主に▲0.015%~▲0.010%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▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達スタンスに大きな変化はなく、出合の水準は概ね横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報 1月27日	日銀予想 1月28日	当社需給予想 1月29日
券	+700	+500	+0
財政	+15,400	+1,500	▲4,000
過不足	+16,100	+2,000	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲5,900	+7,000	▲300
CP等買入	▲600		
社債等買入			+1,000
ETF買入			
国債補完供給	+200		+100
当座預金増減	+16,800	+1,800	▲3,000
当座預金残高	4,010,400	4,012,200	4,009,200
準備預金残高	3,480,000	主な需給要因	
積み終了先	3,478,800		
超過準備	3,478,800		
非準備先残高	530,400	国債発行(40年)	
準備預金進捗率	99.7%		
平均	38.7%		
乖離率	61.0%		

1月27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
国債補完供給(1/27~1/28)	2	2	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
1月24日時点 5,135,100

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,239,300
1月28日以降の残り所要積数	9,000
平均	500

国庫短期証券入札予定

1月31日	3ヶ月	第885回
2月6日	6ヶ月	
2月7日	3ヶ月	
2月14日	3ヶ月	
1月28日	40年	
1月30日	2年	
2月4日	10年	
2月6日	30年	

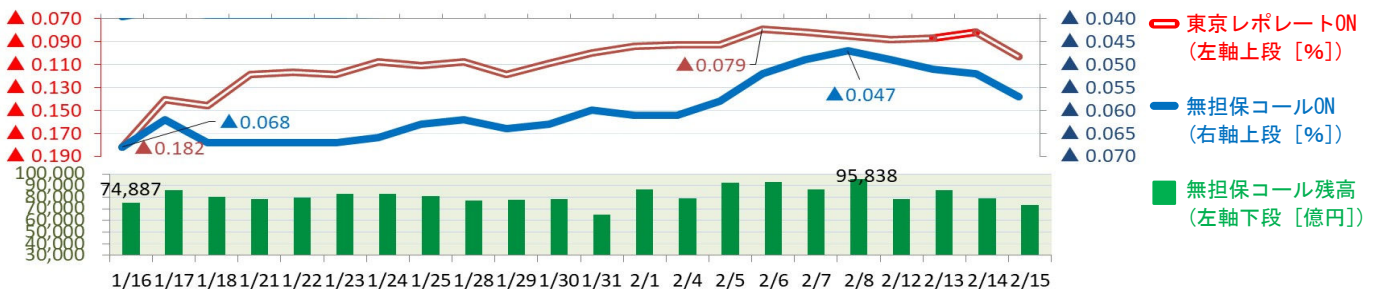
今月の国債買入オペ予定

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	1月20日	1
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20日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	1月23日	1
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23日	0
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	1月23日	0
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

○2019年1月積み期 [1月16日~2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。