

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年1月29日(水)

短期市場の推移

	1月23日	1月24日	1月27日	1月28日
加重平均金利	▲0.018	▲0.016	▲0.019	▲0.020
東京レポレート(ON)	▲0.074	▲0.079	▲0.071	▲0.083
無コール残	92,013	83,595	78,501	84,423
ON	65,108	55,435	50,601	55,823
その他	26,905	28,160	27,900	28,600
有コール残	19,012	19,498	19,440	19,208

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。無コール残は無担保・有担保コール残高の意。

1月30日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
16:00頃	【講演】両宮副総裁 (時事通信社 「金融懇話会」)	21:00	(英)1月英中銀(BOE) 政策金利
	-	22:30	(米)10-12月期 国内総生産(GDP) 速報値[前期比年率]
	-	22:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分]

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	▲0.060	0.001	▲0.025	▲0.101
T/N	-	-	-	▲0.124
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.010	▲0.017	▲0.104
2W	-	-	0.000	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.096
1M	-	-	-	▲0.094
2M	-	-	▲0.015	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.136
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▲0.02%の出合から始まった。その後は主に▲0.025%~▲0.010%の水準で取引された。昨日に比べビットサイドが慎重な姿勢となり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.025%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

本日対比較調な地合いを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月29日	1月30日	1月30日	1月31日		
券	+400	+200	+200	+500		
財政	▲3,300	+6,200	+6,200	+2,700		
過不足	▲2,900	+6,400	+6,400	+3,200		
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート		
国庫短期証券買入		+7,500				
国債買入			+12,000			
CP等買入	▲100		▲200	+2,500		
社債等買入		+1,000				
ETF買入		+600		+100		
国債補完供給	+100	▲200	+200			
当座預金増減	+6,000	+18,500	+18,500	+5,700		
当座預金残高	4,016,900	4,035,400	4,035,400	4,041,100		
準備預金残高	3,489,500	主な需給要因				
積み終了先	3,489,100					
超過準備	3,489,100					
非準預先残高	527,400					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	45.2%					
乖離率	54.6%					

1月29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(1/30~)						
~1年	500	1,402	502	0.006	0.008	32.4
1~3年	4,200	11,227	4,202	0.006	0.007	86.6
3~5年	3,400	9,444	3,406	0.003	0.004	54.9
5~10年	3,500	7,010	3,514	0.003	0.004	86.9
国債補完供給(1/29~1/30)						
		188	188	▲0.350	▲0.350	

マネタリーベース [億円]
1月28日時点 5,151,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,239,300
1月30日以降の残り所要積数 7,900
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30日	2年	
2月4日	10年	
2月6日	30年	
2月12日	物価連動	

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29日	0
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29日	0
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	1月29日	0
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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会