

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年2月12日(水)

## 短期市場の推移

	2月5日	2月6日	2月7日	2月10日
加重平均金利	▲0.015	▲0.016	▲0.014	▲0.010
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.086	▲0.062	▲0.054
無コール残	89,297	95,330	101,779	90,381
ON	60,217	66,165	65,744	53,896
その他	29,080	29,165	36,035	36,485
有コール残	19,563	19,357	19,244	19,114

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。

## 2月13日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	企業物価指数(1月)	-	22:30 (米)1月消費者物価コア指数[前年比]	2.2%
10:00	営業毎旬報告(2月10日現在)	-	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	▲0.008	▲0.077
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.083
2W	-	-	-	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.086
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	0.020	▲0.133
1Y	-	-	-	▲0.159

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▲0.005%の出合から始まった。その後は主に▲0.010%~▲0.003%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+0.002%の▲0.008%と、2019年12月13日以来約2か月ぶりの高水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.003

## 翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、本日と同様の堅調な地合になると予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月12日	2月13日	2月13日	2月14日	2月14日	2月15日
券	+900	▲400	▲400	+0	+0	+0
財政	▲600	▲5,500	▲5,500	+74,000	+74,000	+74,000
過不足	+300	▲5,900	▲5,900	+74,000	+74,000	+74,000
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
国庫短期証券買入				+7,500		
国債買入		+2,300				
CP等買入	▲100		▲100			
ETF買入		+500		+200		
国債補完供給	+100	▲100	+100			
当座預金増減	+3,000	+1,800	+1,800	+74,000	+74,000	+74,000
当座預金残高	3,911,000	3,912,800	3,912,800	3,986,800	3,986,800	3,986,800
準備預金残高	3,404,800	3,404,800	3,404,800	3,404,800	3,404,800	3,404,800
積み終了先	3,404,700	3,404,700	3,404,700	3,404,700	3,404,700	3,404,700
超過準備	3,404,600	3,404,600	3,404,600	3,404,600	3,404,600	3,404,600
非準備預金残高	506,200	506,200	506,200	506,200	506,200	506,200
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	90.3%	90.3%	90.3%	90.3%	90.3%	90.3%
乖離率	9.6%	9.6%	9.6%	9.6%	9.6%	9.6%

## 2月12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
国庫短期証券買入(2/13~)	7,500	24,516	7,503	0.005	0.007	28.7
米ドル資金供給(2/14~2/21)	4	4	2.080	2.080		
国債補完供給(2/12~2/13)	64	64	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [ 億円 ]	所要 [ 億円 ]
2月10日時点 5,044,300	今積期の所要準備額 3,241,200
	2月13日以降の残り所要積数 500
	平均 200

## 国庫短期証券入札予定

2月14日	3ヶ月	第888回
2月19日	1年	第889回
2月21日	3ヶ月	
2月28日	3ヶ月	

## 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	2月10日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200	7 13 21 27	2月7日	3
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 13 21 27	2月7日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 13 21 27	2月7日	3
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	10 25	2月10日	1
25年超	0~500 程度	300	月2回程度	2月7日	1
物価運動債	300 程度	300	月1回	12月9日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

## 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