

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年2月13日(木)

短期市場の推移

	2月6日	2月7日	2月10日	2月12日
加重平均金利	▲0.016	▲0.014	▲0.010	▲0.008
東京レポレート(ON)	▲0.086	▲0.062	▲0.054	▲0.077
無コール残	95,330	101,779	90,381	84,793
ON	66,165	65,744	53,896	57,878
その他	29,165	36,035	36,485	26,915
有コール残	19,357	19,244	19,114	18,655

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14日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
19:00 【講演】両宮副総裁(東京証券取引所主催セミナー)	-	19:00 (欧)12月貿易収支	-
-	-	19:00 (欧)10-12月期域内総生産(GDP)改定値[前年比]	1.0%
-	-	23:15 (米)1月鉱工業生産指数[前月比]	-0.2%

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	▲0.093
T/N	▲0.010	▲0.005	▲0.006	▲0.108
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.011	▲0.003	▲0.004	▲0.092
2W	-	-	▲0.010	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.092
1M	-	-	▲0.010	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲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)は前営業日と横ばいの▲0.008%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.008	▲0.010 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

週末3日積みも調達意欲は強く、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 2月13日	日銀予想 2月14日	当社需給予想 2月17日
券	▲200	+200	+0
財政	▲6,300	+73,900	+5,000
過不足	▲6,500	+74,100	+5,000
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		+12,400	
CP等買入	▲100	▲100	
ETF買入	+200		
国債補完供給	+100 ▲100	+100	
当座預金増減	+1,100	+86,500	+5,000
当座預金残高	3,912,100	3,998,600	4,003,600
準備預金残高	3,397,700	主な需給要因	
積み終了先	3,397,600	年金定時払い	
超過準備	3,397,600	国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備先残高	514,400	国債発行(個人)	
準備預金進捗率	99.9%	国債償還(2年)	
平均	93.5%		
乖離率	6.4%		

2月13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(2/14~)						
1~3年	4,200	17,951	4,204	0.000	0.003	48.8
3~5年	3,400	11,130	3,404	0.005	0.006	95.2
5~10年	3,500	12,341	3,501	0.009	0.010	97.1
変動利付	1,000	3,097	1,006	▲0.260	▲0.262	37.0
国債補完供給(2/13~2/14)			110	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
2月12日時点 5,046,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,241,200
2月14日以降の残り所要積数 400
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	
2月18日	5年	
2月20日	20年	
2月28日	2年	
3月3日	10年	

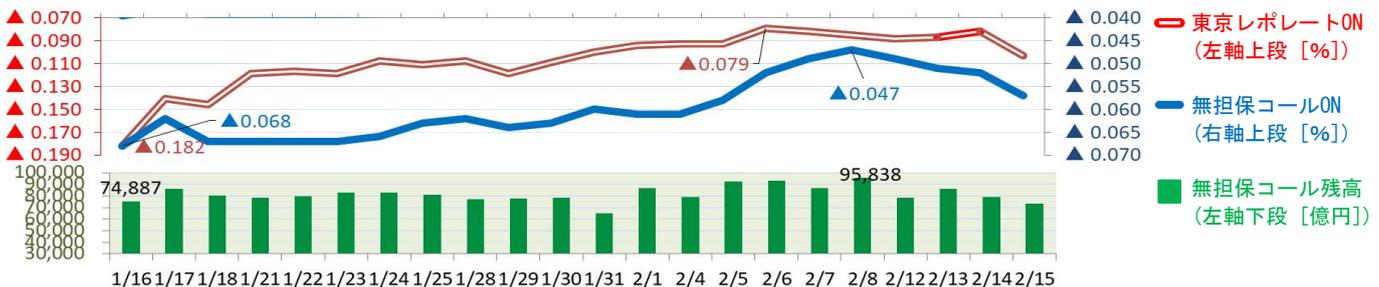
今月の国債買入オペ予定

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	2月10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	7 13 21 27	2月13日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 13 21 27	2月13日	2
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	10 25	2月10日	1
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	2月7日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	2月13日	0

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。