



デイリーシグナル

2021年1月19日(火)

短期市場の推移

	1月13日	1月14日	1月15日	1月18日
加重平均金利	▲0.012	▲0.008	▲0.015	▲0.024
東京レポレート(TN)	▲0.077	▲0.079	▲0.085	▲0.082
無コール残	107,082	104,436	97,521	108,904
ON	66,169	62,023	61,138	72,201
その他	40,913	42,413	36,383	36,703
有コール残	20,192	20,401	18,443	21,198

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
 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	▲0.065	0.001	▲0.021	▲0.083
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.003	▲0.081
S/N	-	-	0.001	-
1W	▲0.020	▲0.010	▲0.014	▲0.083
2W	▲0.012	0.120	▲0.002	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	▲0.023	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.111
1Y	-	-	-	▲0.141

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

1月20日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)11次期財務長官の承認公聴会(上院)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%の合出から始まった。その後は主に▲0.030%~▲0.013%の水準で合出が見られた。新積み期序盤ではあるが地銀業態が積極的な調達姿勢を取っており、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.021%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

出合いの水準は、本日対比横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月19日	1月20日	1月20日	1月21日	1月21日	1月22日
券		+1,800		+900		+0
財政		+4,500		▲27,700		▲4,000
過不足		+6,300		▲26,800		▲4,000
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				
CP等買入	▲100	+6,000	▲900			
E T F 買入		+200		+200		
国債補完供給	+200	▲400	+400			
当座預金増減		+19,700		▲27,100		▲4,000
当座預金残高		4,879,700		4,852,600		4,848,600
準備預金残高		4,270,400	主な需給要因			
積み終了先		4,266,800	国債発行(20年)			
超過準備		4,265,100	国庫短期証券			
非準備先残高		609,300	発行・償還(1Y)			
準備預金進捗率		99.7%				
平均		12.9%				
乖離率		86.8%				

1月19日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

オベ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(1/19~1/20)	388	388	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
1月18日時点 6,069,900

所要	今積期の所要準備額	1月20日以降の残り所要
	3,604,600	
積数	10,500	
平均	400	

国庫短期証券入札予定

1月20日	6ヶ月	第967回
1月22日	3ヶ月	第968回
1月29日	3ヶ月	
2月5日	3ヶ月	

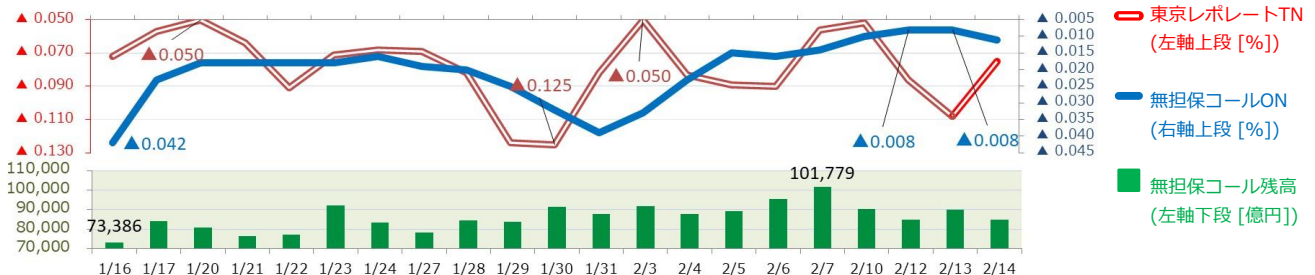
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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	1,000~2,000	1,500	月2回程度	1月12日	1
1年超3年以下	3,000~6,000	4,500	5 14 20 25 27	1月14日	3
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	5 12 20 25 29	1月12日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 12 20 25 29	1月12日	3
10年超25年以下	500~2,000	1,200	12 27	1月12日	1
25年超	0~500	300	14 29	1月14日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	1月14日	1
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	12月7日	-

1年前の市場推移

○2020年1月積み期 [1月16日~2月14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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会