

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年1月16日(木)

短期市場の推移

	1月9日	1月10日	1月14日	1月15日
加重平均金利	▲0.052	▲0.035	▲0.028	▲0.016
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.112	▲0.092	▲0.076
無コール残	74,375	80,044	85,267	91,352
ON	46,515	50,619	56,862	62,347
その他	27,860	29,425	28,405	29,005
有コール残	20,295	20,686	21,147	19,158

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		11:00	(中)10-12月期国内総生産(GDP)[前年比] 6.0%
-		18:00	(欧)11月経常収支 -
-		23:15	(米)12月鉱工業生産指数[前月比] 0.1%

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	▲0.080	0.001	▲0.042	▲0.074
T/N	-	-	-	▲0.072
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.008	▲0.013	▲0.073
2W	▲0.010	▲0.005	▲0.008	▲0.074
3W	-	-	-	▲0.078
1M	-	-	▲0.022	▲0.083
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.134
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

無担保コールON物は▲0.040%の出合から始まった。その後は主に▲0.040%~▲0.025%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▲0.026%の▲0.042%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.050 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

週末3日積みのため調達意欲が強まり、出合いの水準は小幅上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月16日	1月17日	1月17日	1月20日	1月20日
券	+1,700	+2,200	+2,200	+2,000	+2,000
財政	▲24,600	+500	+500	▲11,000	▲11,000
過不足	▲22,900	+2,700	+2,700	▲9,000	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+10,000			
国債買入				+3,700	+2,500
CP等買入	▲100	▲400	▲400		
ETF買入	+600				
国債補完供給	+500	▲800	+800		
当座預金増減	▲12,700	+6,800	+6,800	▲6,500	▲6,500
当座預金残高	3,965,700	3,972,500	3,972,500	3,966,000	3,966,000
準備預金残高	3,454,300				
積み終了先	1,619,800				
超過準備	874,000				
非準備先残高	511,400				
準備預金進捗率	79.7%				
平均	3.2%				
乖離率	76.4%				

1月16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(1/17~)						
5~10年	3,500	13,996	3,507	▲0.005	▲0.005	95.9
国債補完供給(1/16~1/17)			774	774	▲0.350	▲0.350

マナタリーベース [億円]
1月15日時点 5,128,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,239,200
1月17日以降の残り所要積数 658,900
平均 22,000

国庫短期証券入札予定

1月17日	3ヶ月	第883回
1月24日	3ヶ月	
1月31日	3ヶ月	
2月6日	6ヶ月	
1月17日	20年	
1月28日	40年	
1月30日	2年	
2月4日	10年	

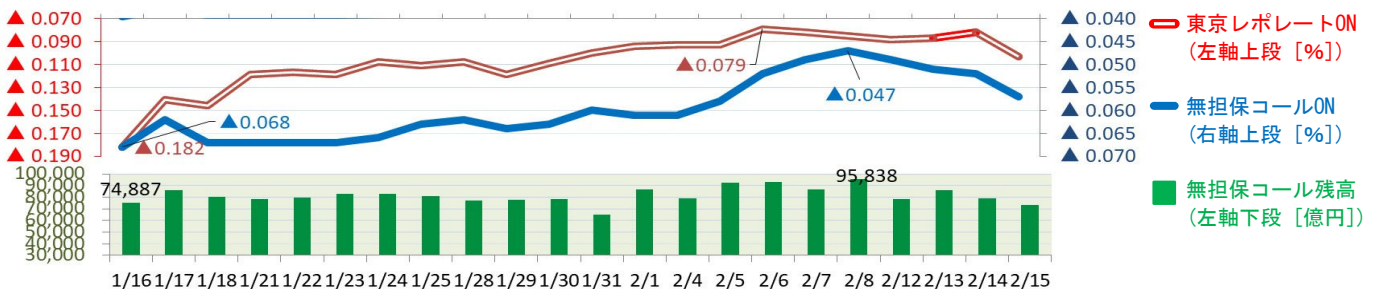
今月の国債買入オペ予定

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	12月25日	2
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10日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	1月16日	2
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14日	1
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	1月10日	1
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。

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