



デイリーシグナル

2021年1月18日(月)

短期市場の推移

	1月12日	1月13日	1月14日	1月15日
加重平均金利	▲0.016	▲0.012	▲0.008	▲0.015
東京レポレート(TN)	▲0.076	▲0.077	▲0.079	▲0.085
無コール残	91,294	107,082	104,436	97,521
ON	54,441	66,169	62,023	61,138
その他	36,853	40,913	42,413	36,383
有コール残	20,284	20,192	20,401	18,443

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	▲0.070	0.001	▲0.024	▲0.082
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.003	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.011	▲0.008	▲0.010	▲0.082
2W	▲0.030	▲0.005	▲0.020	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	▲0.020	▲0.093
2M	▲0.010	0.001	▲0.001	-
3M	-	-	0.080	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.113
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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)イエレン次期財務長官の承認公聴会	-
-	-	18:00 (欧)11月経常収支	-
-	-	-	-

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。新積み期序盤で都銀・地銀が調達に慎重な姿勢を取っており、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.024%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

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18日	1月19日	1月19日	1月20日	1月20日	1月21日
券	+1,500	+1,800	+1,800	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲18,400	+1,000	+1,000	▲28,000	▲28,000	▲28,000
過不足	▲16,900	+2,800	+2,800	▲27,000	▲27,000	▲27,000
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	▲600		▲100	+6,000		
社債等買入	▲100					
E T F 買入		+500		+200		
国債補充供給	+800	▲200	+200			
当座預金増減	▲16,500	+16,600	+16,600	▲27,000	▲27,000	▲27,000
当座預金残高	4,860,000	4,876,600	4,876,600	4,849,600	4,849,600	4,849,600
準備預金残高	4,272,300					
積み終了先	4,257,800					
超過準備	4,241,100					
非準備先残高	587,700					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	9.7%					
乖離率	89.9%					

1月18日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(1/19~)	7,500	25,626	7,501	0.002	0.004	81.9
国債補充供給(1/18~1/19)	159	159	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
1月15日時点 6,088,000

所要	今積期の所要準備額	1月19日以降の残り所要
	3,604,600	
積数	15,900	
平均	600	

国庫短期証券入札予定

1月19日	1年	第966回
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	

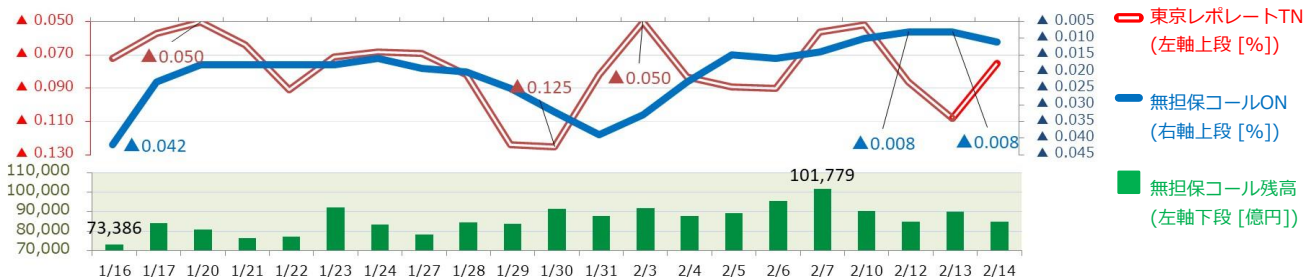
今月の国債買入オペ予定

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	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
物価運動債	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ありません。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