



ブライツ・アセット株式会社

CFTC 投機筋ポジション・レポート(オプション込み)

オプション込みの投資家種別のポジション

毎週更新している CFTC のポジションですが、オプション込みのポジションについてもまとめてみました。データは、2020 年 1 月 7 日クローズのもので、年初レバレッジ・マネーがどういったポジション動向で市場に向き合い始めているのか参考になれば幸いです。

2020/01/14

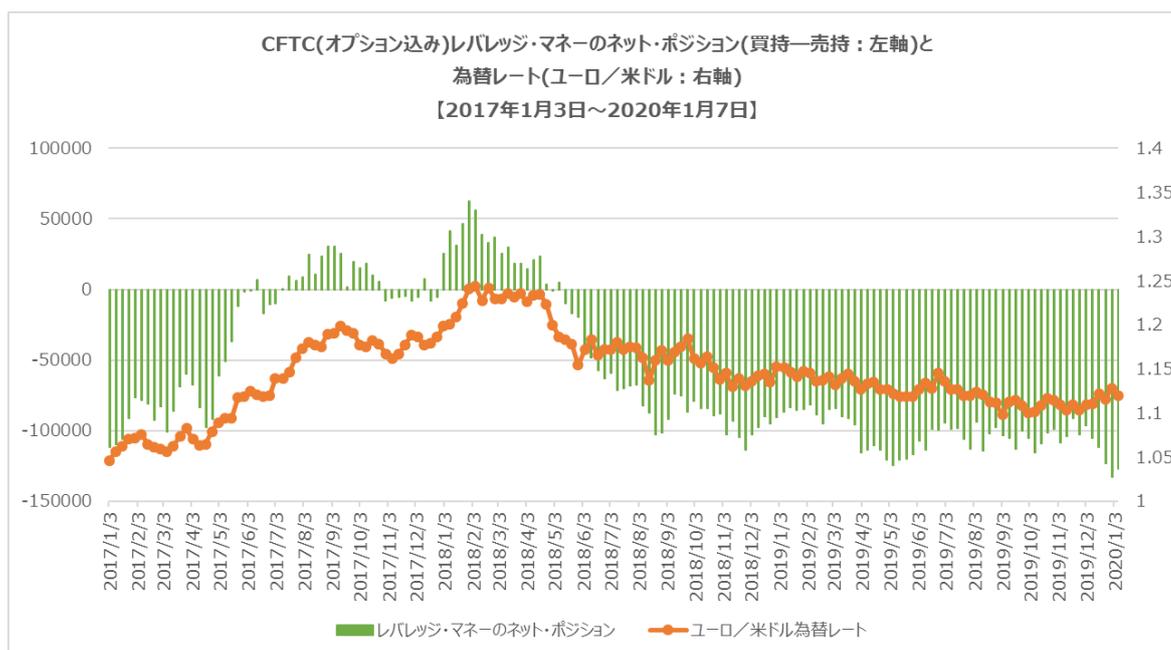
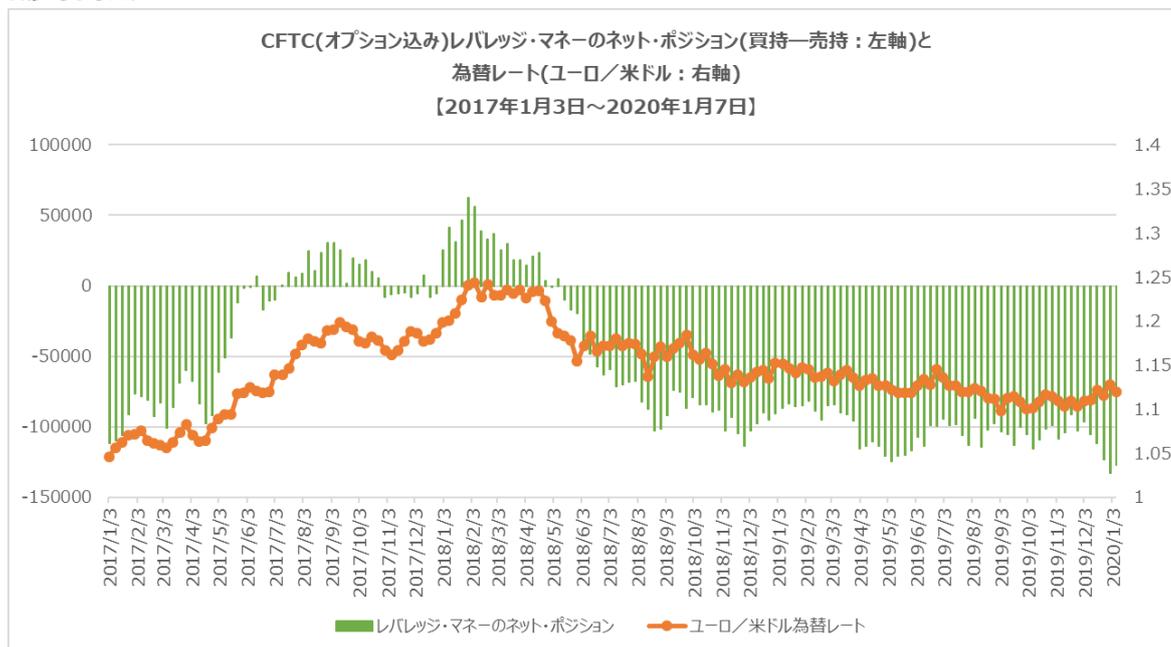
金融商品取引業者：ブライツ・アセット株式会社
登録番号：関東財務局長（金商）第 3102 号
加入協会：一般社団法人第二種金融商品取引業協会
一般社団法人金融先物取引業協会
一般社団法人日本投資顧問業協会
HP : www.brightasset.co.jp

当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライツ・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。

ユーロ/米ドル

EUR/USD 日付	オープン インタレスト	アセット・マネージャー			レバレッジ・マネー			期近終値
		ロング	ショート	ネット	ロング	ショート	ネット	
2019/12/10	690,434	347,922	172,020	175,902	42,484	148,154	-105,670	1.1101
2019/12/17	591,708	343,415	161,160	182,255	37,344	148,952	-111,608	1.1216
2019/12/24	582,686	338,667	153,890	184,777	36,759	159,947	-123,188	1.1150
2019/12/31	616,838	340,992	146,204	194,788	38,707	171,744	-133,037	1.1282
2020/1/7	597,223	347,024	139,526	207,498	34,531	161,717	-127,186	1.1193
先週比	-19,615	6,032	-6,678	12,710	-4,176	-10,027	5,851	-0.0090

レバレッジ・マネーのショートが大きいままですが、若干低下しました。ロングも減少しています。アセット・マネージャーのロングは増加しましたが、ショートは減少しました。

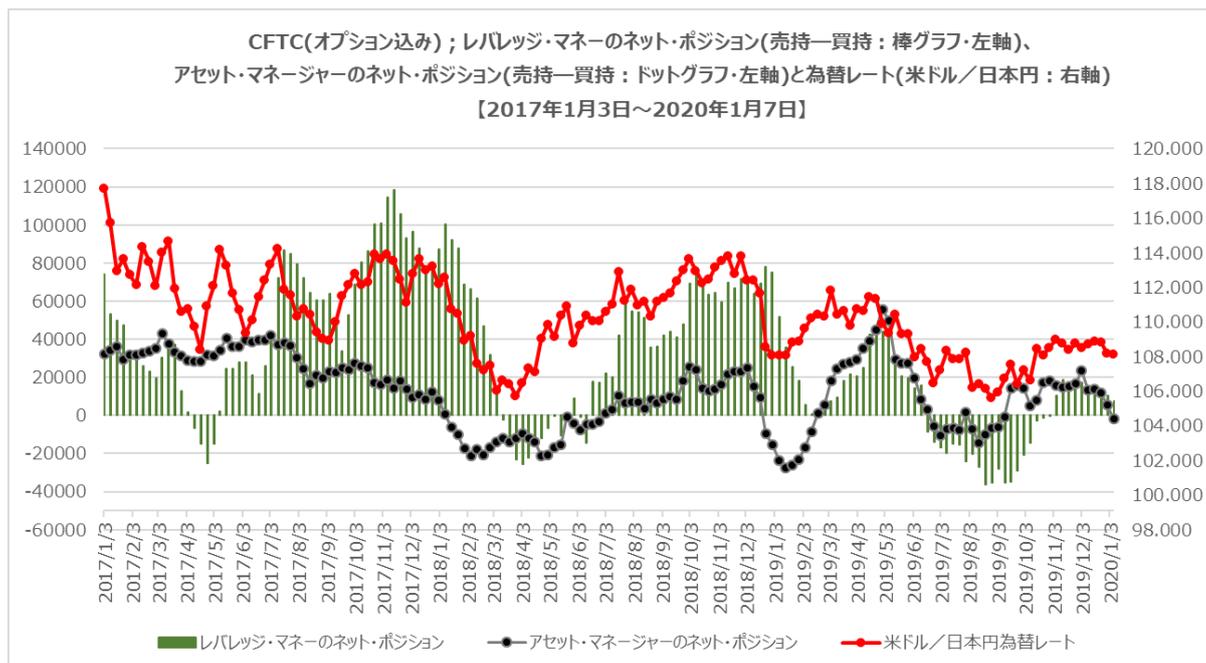
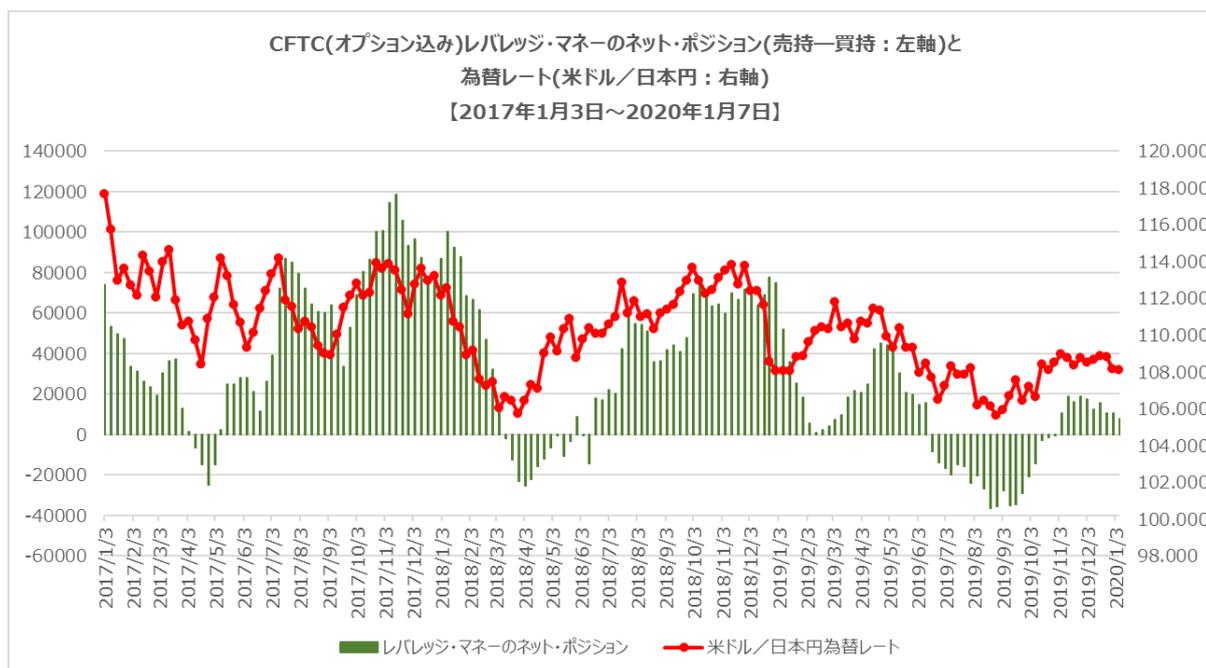


当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライト・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。

米ドル/日本円

USD/JPY 日付	オープン インタレスト	アセット・マネージャー			レバレッジ・マネー			期近終値
		ロング	ショート	ネット	ロング	ショート	ネット	
2019/12/10	218,233	42,364	55,552	13,188	34,355	46,510	12,155	108.690
2019/12/17	198,907	44,627	58,299	13,672	31,264	46,796	15,532	108.867
2019/12/24	192,224	42,972	54,746	11,774	29,257	39,973	10,716	108.838
2019/12/31	195,225	42,896	48,404	5,508	32,184	42,521	10,337	108.155
2020/1/7	180,072	40,913	39,313	-1,600	35,417	43,075	7,658	108.131
先週比	-15,153	-1,983	-9,091	-7,108	3,233	554	-2,679	-0.024

レバレッジ・マネーのショート(円安方向)もロング(円高方向)も増加しました。アセット・マネージャーのロング(円高方向)は若干縮小し、ショート(円安方向)は大幅に縮小しました。ネットはショート(円安)になってきました。

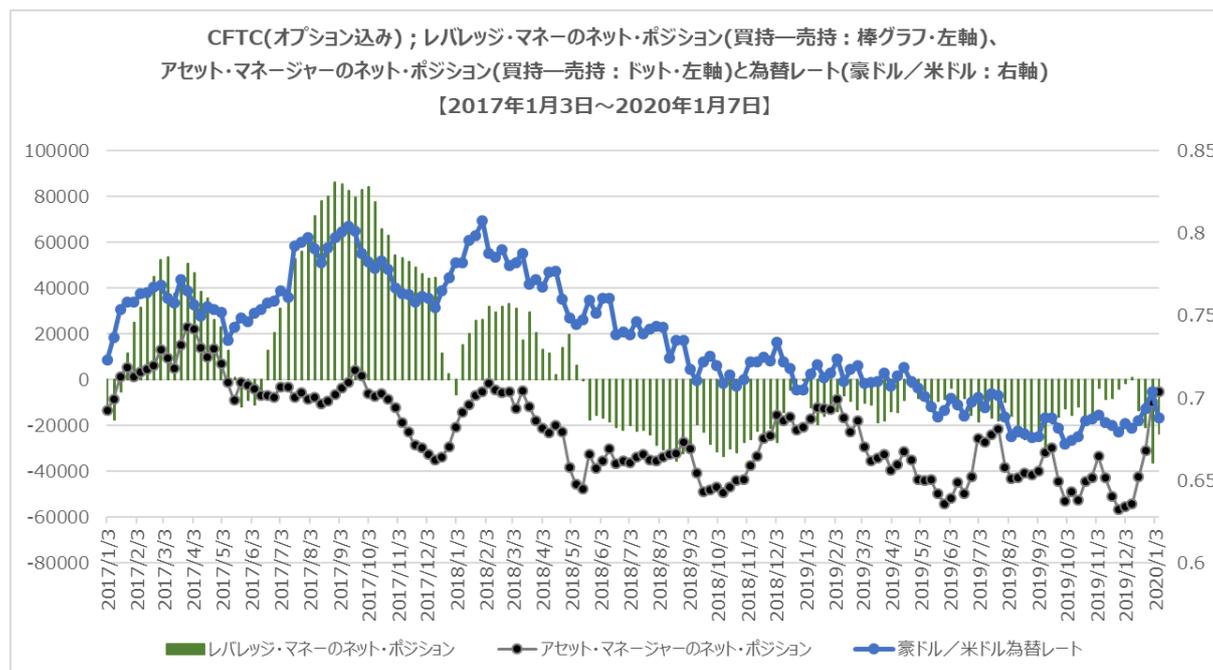
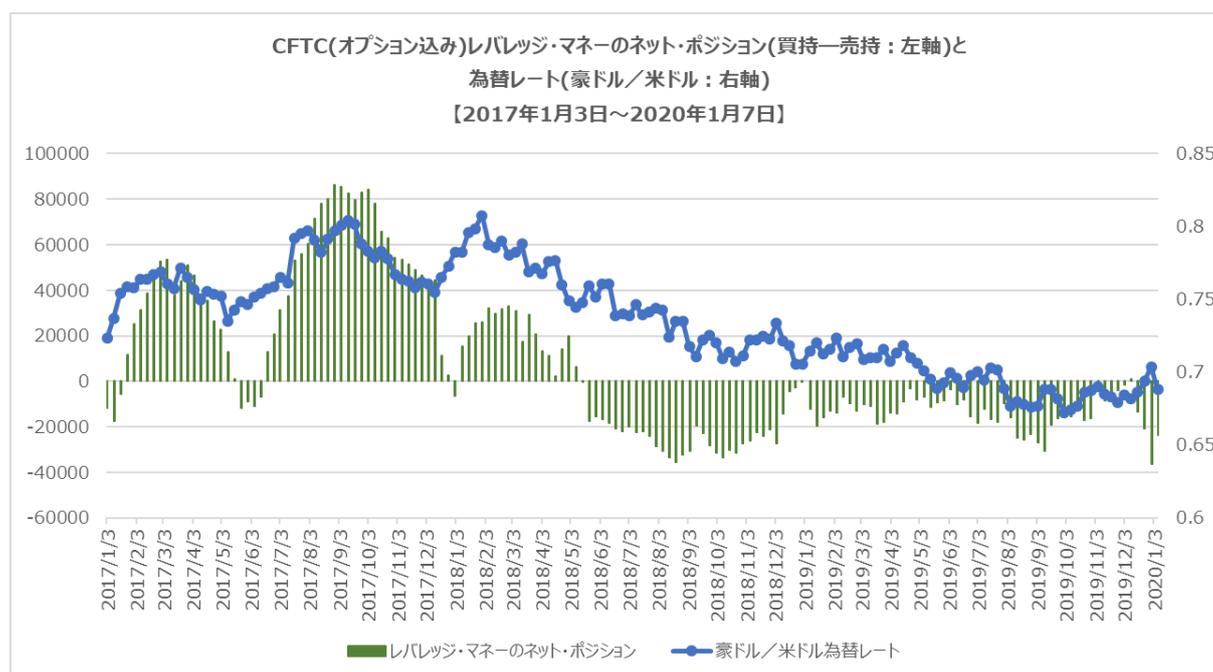


当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライト・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。

豪ドル/米ドル

AUD/USD 日付	オープン インタレスト	アセット・マネージャー			レバレッジ・マネー			期近終値
		ロング	ショート	ネット	ロング	ショート	ネット	
2019/12/10	194,969	17,512	71,914	-54,402	41,894	40,875	1,019	0.6816
2019/12/17	169,088	18,273	60,811	-42,538	27,537	40,827	-13,290	0.6864
2019/12/24	173,619	23,596	54,758	-31,162	31,347	52,172	-20,825	0.6938
2019/12/31	186,804	28,247	38,077	-9,830	34,810	71,074	-36,264	0.7038
2020/1/7	171,917	27,360	32,510	-5,150	42,204	65,927	-23,723	0.6880
先週比	-14,887	-887	-5,567	4,680	7,394	-5,147	12,541	-0.0158

アセットマネージャーのロングは増加しましたが、ショートは減少傾向が続いています。ネットではショートカバーが続いています。レバレッジ・マネーのロング、ショートとも増加傾向です。

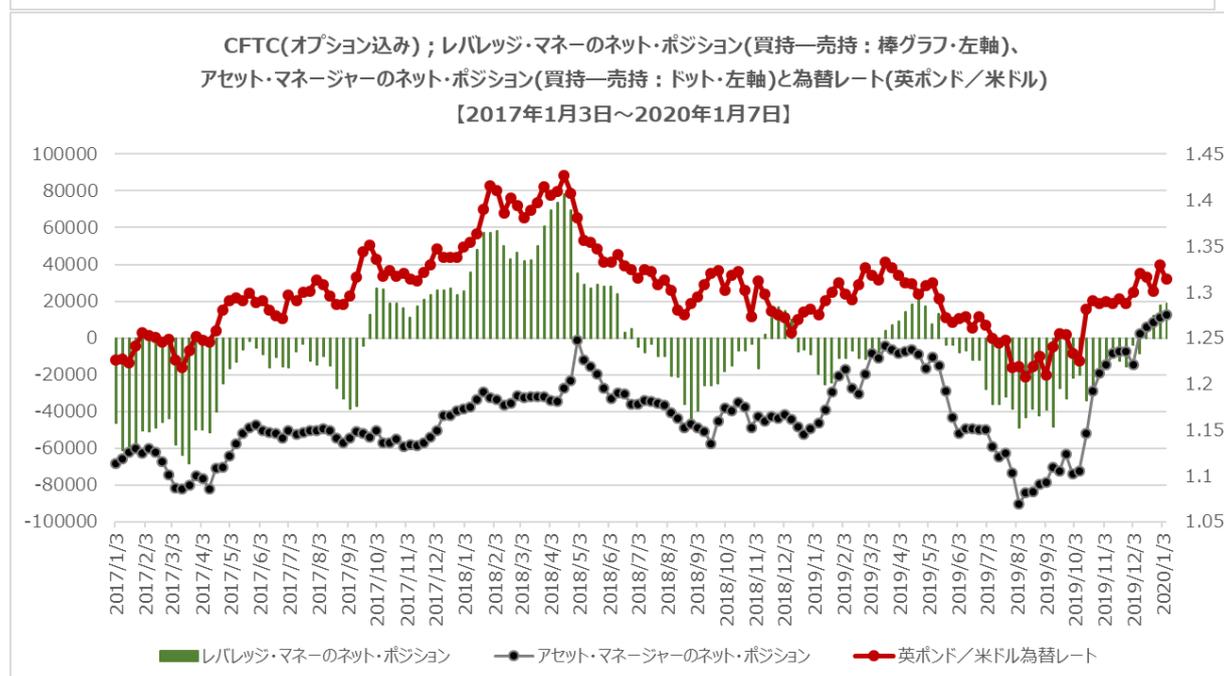
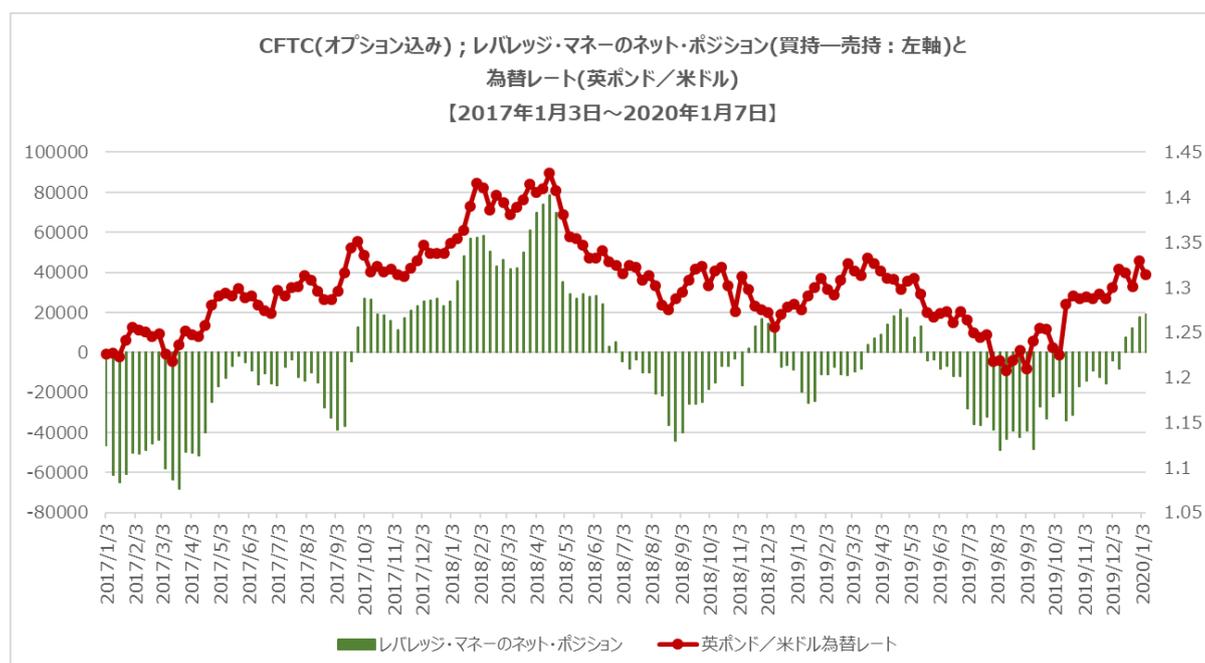


当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライト・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。

英ポンド/米ドル

GBP/USD 日付	オープン インタレスト	アセット・マネージャー			レバレッジ・マネー			期近終値
		ロング	ショート	ネット	ロング	ショート	ネット	
2019/12/10	280,774	75,257	73,083	2,174	45,680	53,950	-8,270	1.3207
2019/12/17	226,820	74,747	68,736	6,011	51,269	43,713	7,556	1.3158
2019/12/24	227,988	73,577	65,196	8,381	60,004	47,726	12,278	1.3003
2019/12/31	233,003	72,209	61,375	10,834	59,976	42,182	17,794	1.3292
2020/1/7	214,984	76,765	64,133	12,632	57,735	38,882	18,853	1.3146
先週比	-18,019	4,556	2,758	1,798	-2,241	-3,300	1,059	-0.0146

レバレッジ・マネーのショートが縮小傾向になっています。ネットではロングに傾き増加傾向です。アセット・マネージャーもネット・ロング傾向になっています。

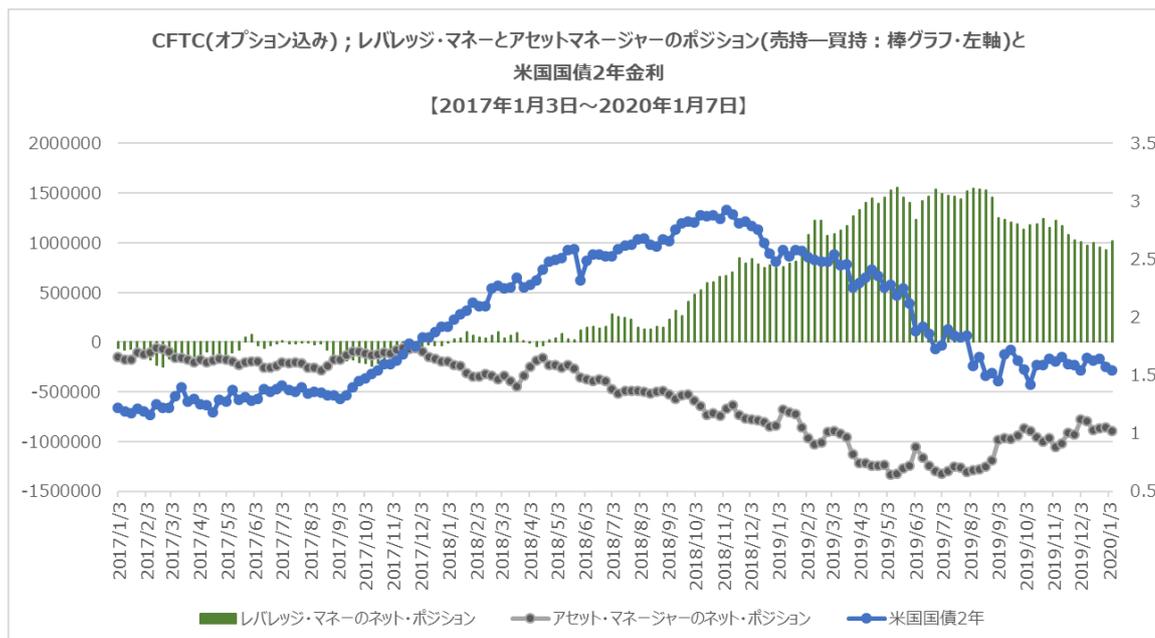
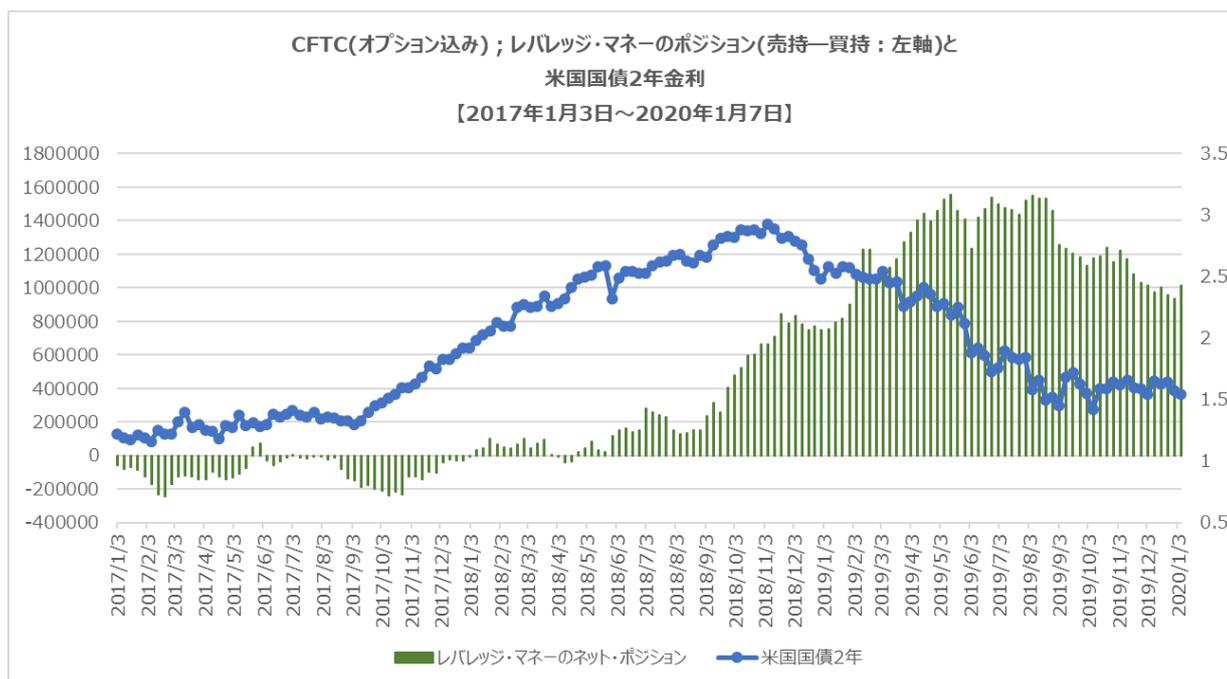


当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライト・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。

米国国債2年

TSY2Yr 日付	オープン	アセット・マネージャー			レバレッジ・マネー			期近終 値
	インタレスト	ロング	ショート	ネット	ロング	ショート	ネット	
2019/12/10	3,583,719	1,656,694	860,687	-796,007	850,989	1,823,113	972,124	1.65
2019/12/17	3,670,196	1,741,914	853,764	-888,150	905,332	1,909,152	1,003,820	1.63
2019/12/24	3,691,601	1,736,327	872,369	-863,958	934,556	1,892,283	957,727	1.64
2019/12/31	3,610,706	1,739,550	883,115	-856,435	902,479	1,834,475	931,996	1.57
2020/1/7	3,569,629	1,724,049	828,648	-895,401	849,249	1,862,953	1,013,704	1.54
先週比	-41,077	-15,501	-54,467	-38,966	-53,230	28,478	81,708	-0.03

レバレッジ・マネーのショート（金利上昇）は横這い傾向です。アセット・マネージャーのロング（金利低下方向）も横這い傾向です。オープンインタレストは高水準で横ばいです。

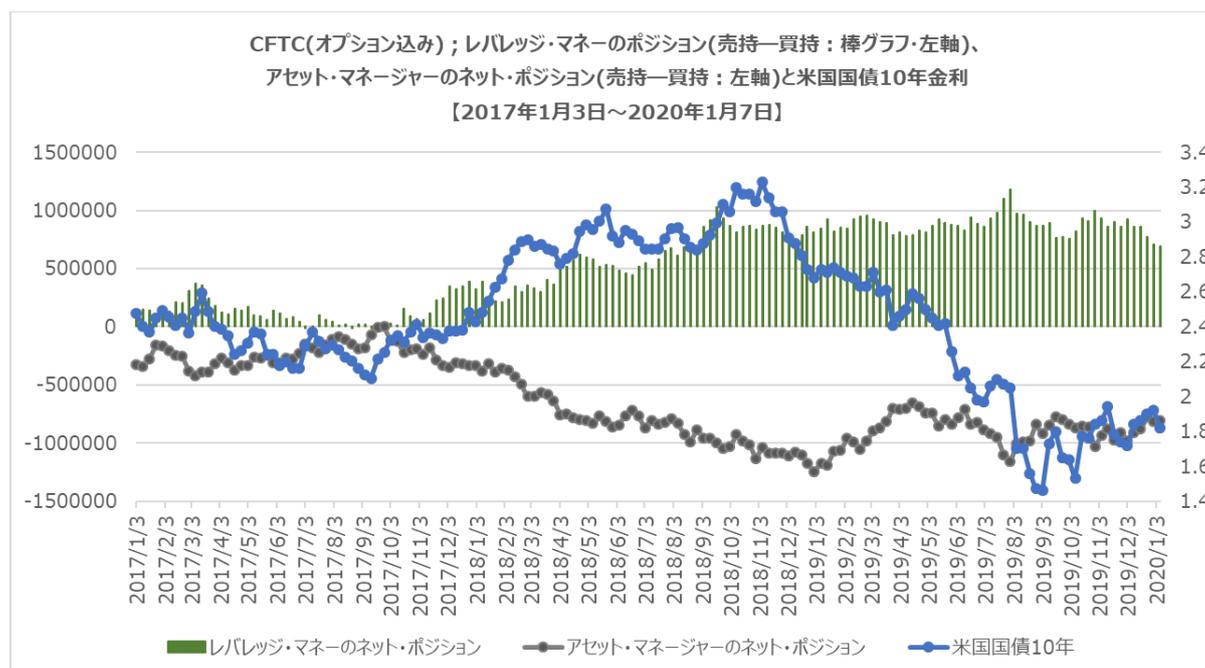
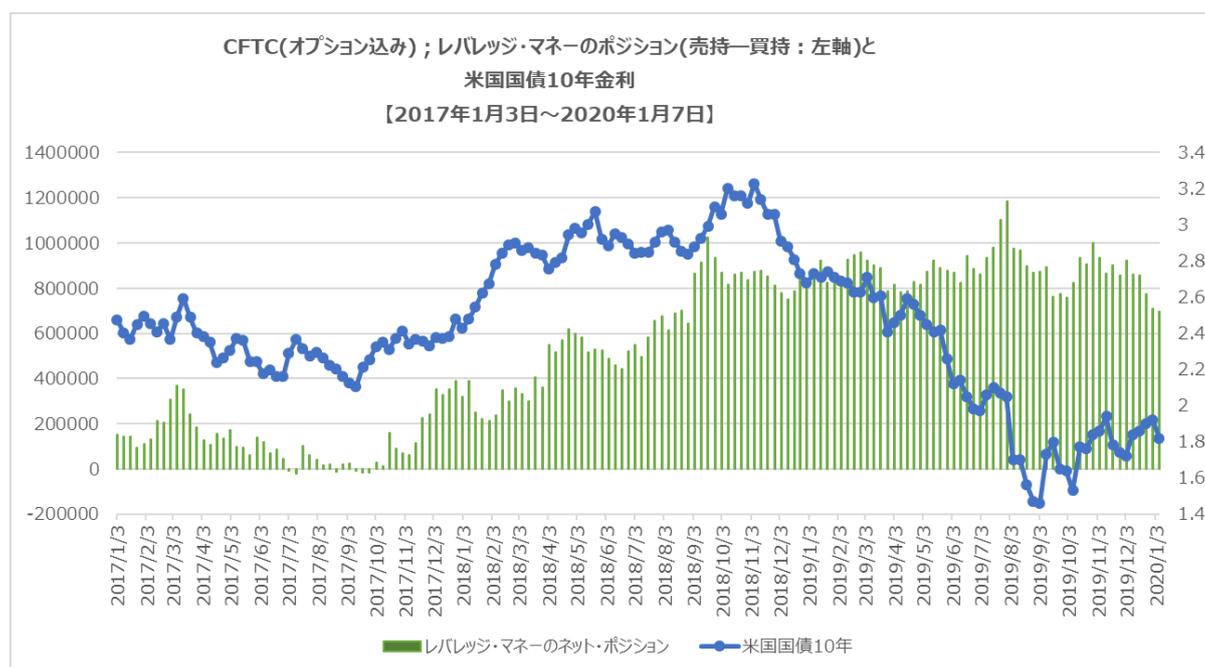


当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライト・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。

米国国債10年

TSY10Yr 日付	オープン	アセット・マネージャー			レバレッジ・マネー			期近終値
	インタレスト	ロング	ショート	ネット	ロング	ショート	ネット	
2019/12/10	4,453,063	1,668,247	754,996	-913,251	376,223	1,238,419	862,196	1.84
2019/12/17	4,354,851	1,690,723	809,717	-881,006	339,420	1,197,489	858,069	1.86
2019/12/24	4,500,633	1,610,416	835,531	-774,885	356,835	1,132,211	775,376	1.90
2019/12/31	4,175,966	1,624,547	809,517	-815,030	350,208	1,058,923	708,715	1.92
2020/1/7	4,516,669	1,622,623	818,924	-803,699	454,309	1,148,896	694,587	1.82
先週比	340,703	-1,924	9,407	11,331	104,101	89,973	-14,128	-0.10

レバレッジ・マネーのショート(金利高方向)、ネットポジションはほぼ横ばいですが縮小傾向です。アセット・マネージャーのショート、ネットポジションとも横ばいになってきました。

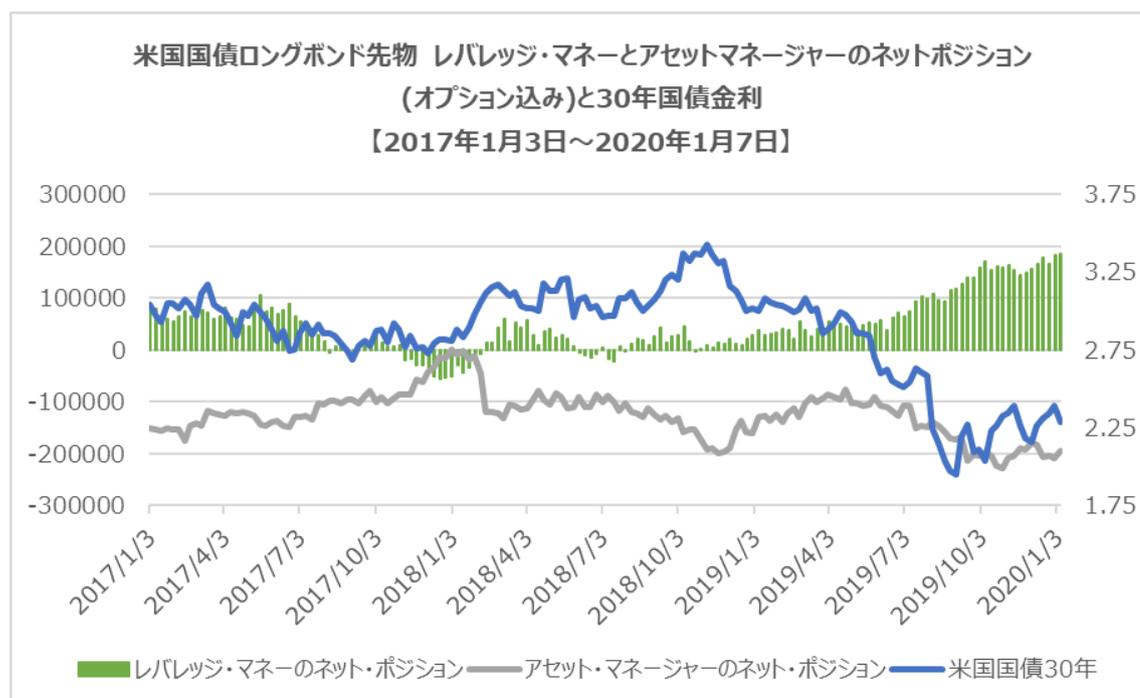
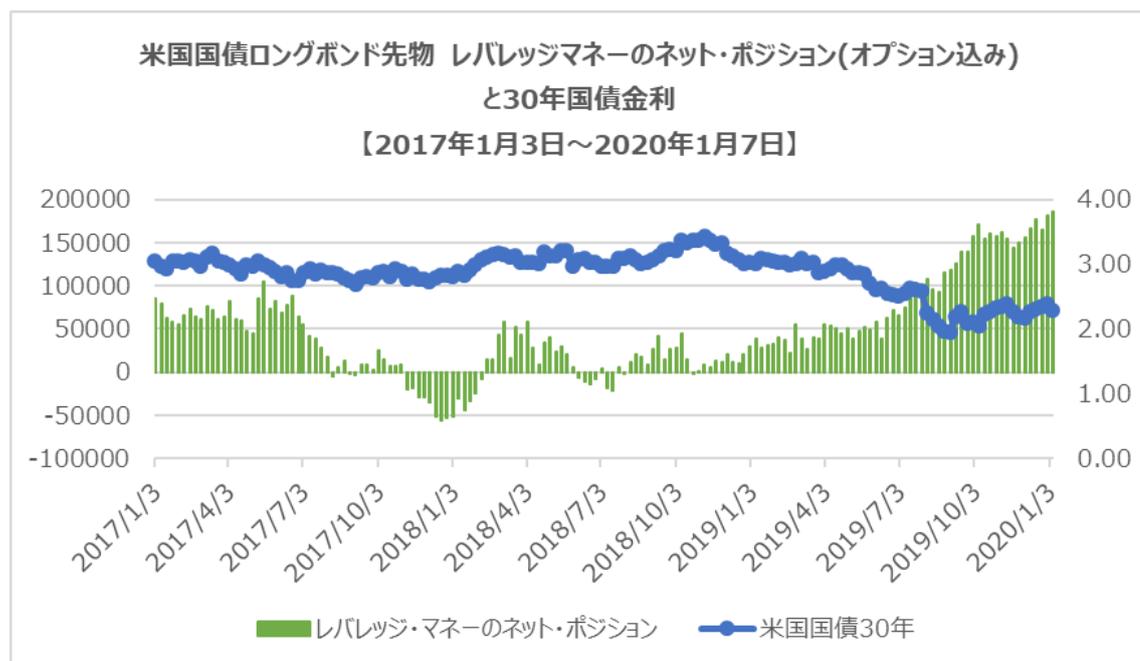


当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライト・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。

米国国債30年

TSY30Yr 日付	オープン インタレスト	アセット・マネージャー			レバレッジ・マネー			期近終値
		ロング	ショート	ネット	ロング	ショート	ネット	
2019/12/10	1,174,606	463,785	280,843	-182,942	54,910	221,590	166,680	2.26
2019/12/17	1,227,199	505,442	298,413	-208,425	67,329	244,590	181,831	2.31
2019/12/24	1,241,924	506,576	303,162	-203,414	67,112	231,943	164,831	2.34
2019/12/31	1,172,897	510,892	302,467	-207,029	61,750	243,581	177,261	2.39
2020/1/7	1,180,992	499,500	304,141	-182,942	60,614	246,075	166,680	2.29
先週比	8,095	-11,392	1,674	13,066	-1,136	2,494	3,630	-0.10

アセットマネージャーのロング・ショートとも横ばいです。レバレッジ・マネーのロング・ショートとも横ばいです。

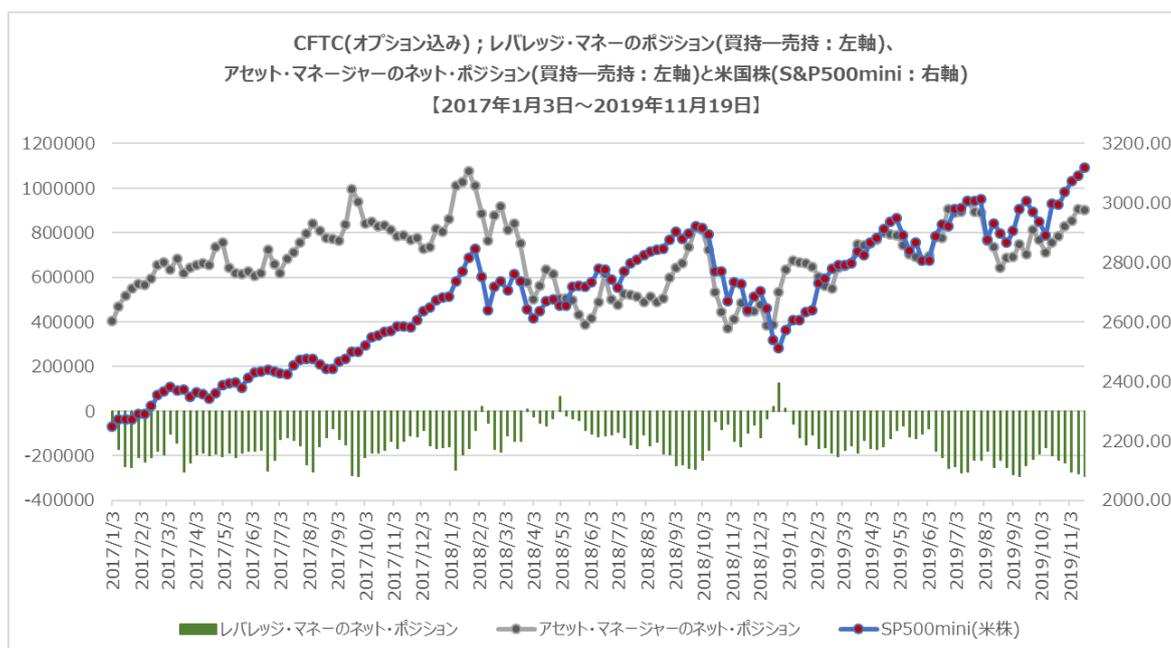
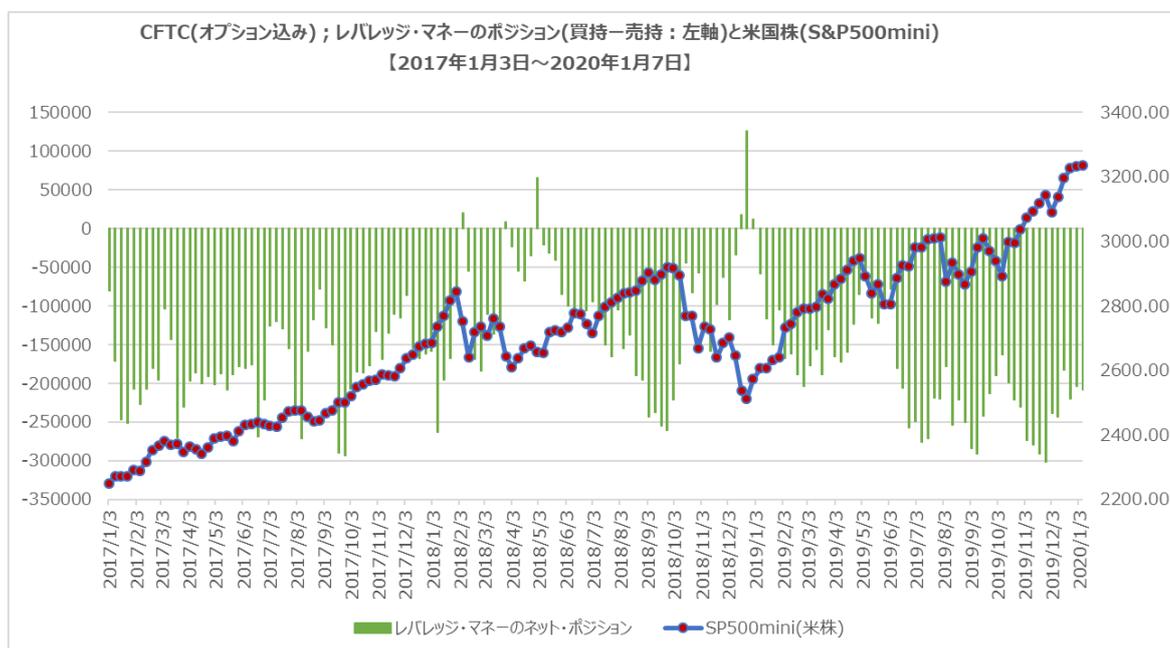


当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライト・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。

米株 (SP500mini)

SP500mini 日付	オープン インタレスト	アセット・マネージャー			レバレッジ・マネー			期近終値
		ロング	ショート	ネット	ロング	ショート	ネット	
2019/12/10	3,860,841	1,429,832	537,608	892,224	221,760	464,908	-243,148	3136.0
2019/12/17	4,181,566	1,394,835	529,686	865,149	315,502	498,724	-183,222	3195.5
2019/12/24	3,467,937	1,548,813	490,207	1,058,606	250,553	470,719	-220,166	3225.8
2019/12/31	3,413,165	1,525,202	489,442	1,035,760	287,780	492,088	-204,308	3231.0
2020/1/7	3,462,397	1,527,790	484,303	1,043,487	292,866	501,362	-208,496	3235.3
先週比	49,232	2,588	-5,139	7,727	5,086	9,274	-4,188	4.3

レバレッジ・マネーのロング、ショートとも増加傾向ですが、ネットではショートが増加傾向です。アセット・マネージャーのロングは増加傾向ですが、ショートは減少傾向です。ネットのロングは増加傾向です。2017～2018年と同じくらい高水準になってきています。

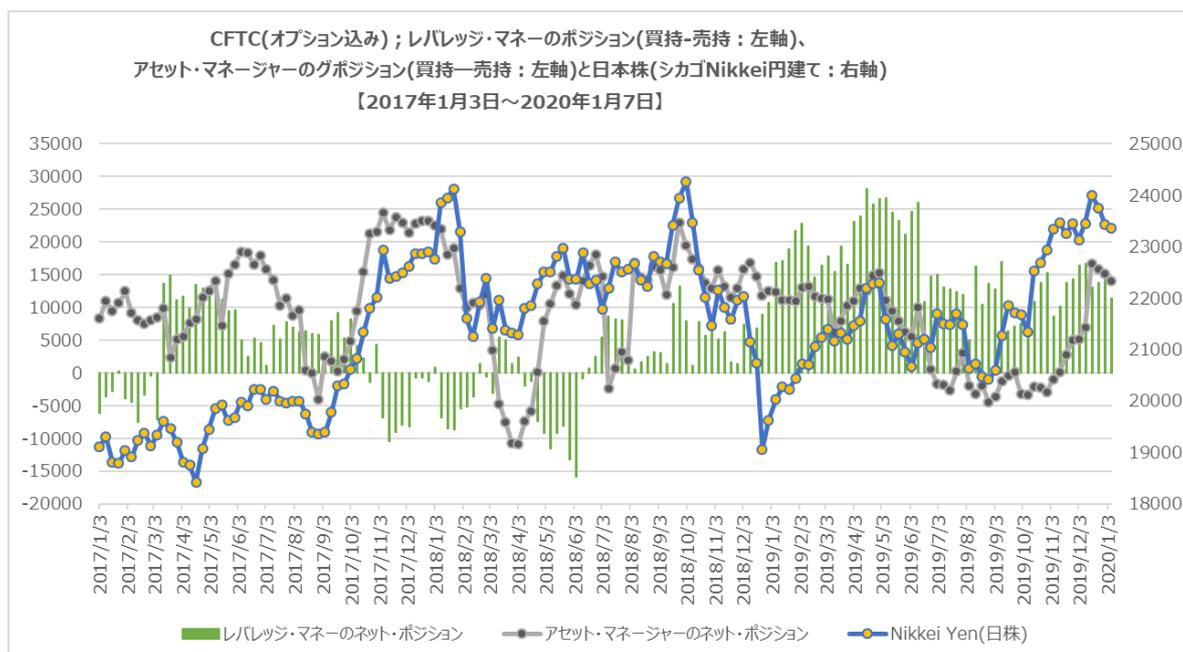
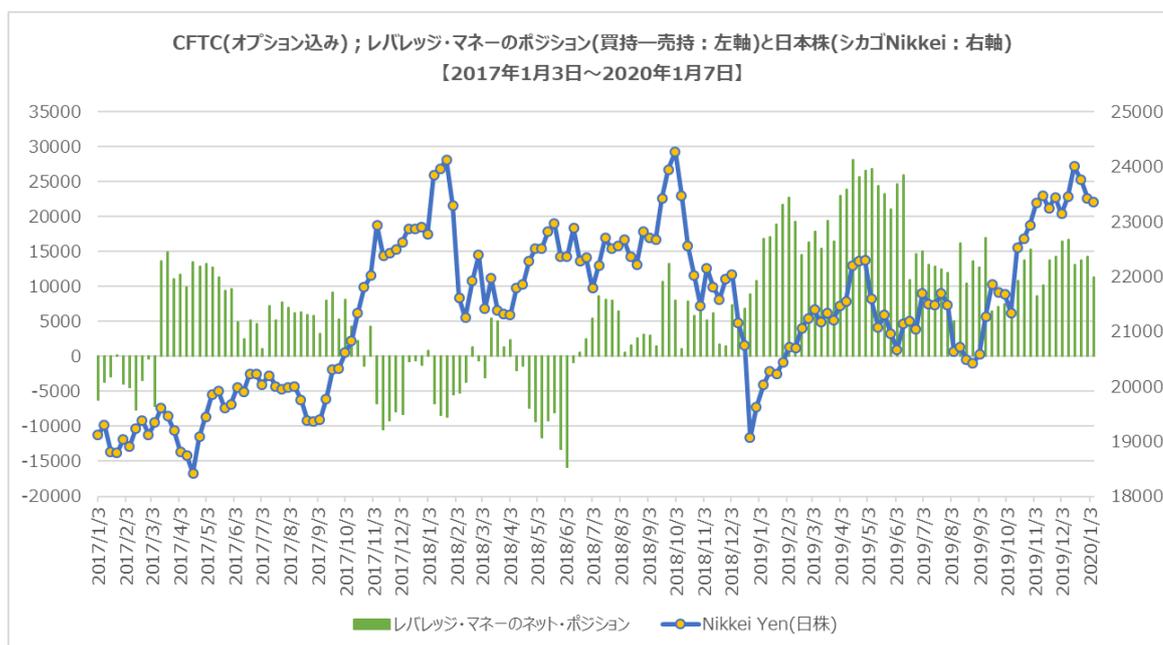


当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライト・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。

日本株（シカゴ Nikkei 円建て）

Nikkei Yen 日付	オープン インタレスト	アセット・マネージャー			レバレッジ・マネー			期近終値
		ロング	ショート	ネット	ロング	ショート	ネット	
2019/12/10	98,981	18,532	11,538	6,994	39,708	23,064	16,644	23450.0
2019/12/17	57,867	21,639	4,983	16,656	19,338	6,221	13,117	24000.0
2019/12/24	59,413	20,438	4,566	15,872	20,101	6,334	13,767	23755.0
2019/12/31	60,519	19,566	4,379	15,187	21,100	6,889	14,211	23425.0
2020/1/7	58,196	18,201	4,150	14,051	20,740	9,373	11,367	23350.0
先週比	-2,323	-1,365	-229	-1,136	-360	2,484	-2,844	-75

レバレッジ・マネーのロングは減少しています。ショートは増加しました。ネットでは減少(売方向)傾向です。アセット・マネージャーのロング・ショートとも縮小傾向です。ネット・ポジションは横這い傾向です。



当資料は、投資環境に関する参考情報の提供を目的としてブライト・アセット株式会社が作成した資料です。投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。ここに示された意見などは、当資料作成日現在の当社の見解であり、事前の連絡なしに変更されることがあります。投資に関する決定は、お客様ご自身で判断なさるようお願いいたします。