

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月11日(金)

短期市場の推移

	1月7日	1月8日	1月9日	1月10日
加重平均金利	▲0.068	▲0.066	▲0.062	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.087	▲0.083	▲0.082	▲0.084
無コール残	80,957	79,937	84,426	83,350
ON	49,562	47,117	51,161	51,165
その他	31,395	32,820	33,265	32,185
有コール残	29,835	32,687	30,054	24,802

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15日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック(12月)	-	19:00 (欧)11月貿易収支	-
10:00	営業毎旬報告(1月10日現在)	-	22:30 (米)12月生産者物価コア指数[前年比]	3.0%
17:00頃	日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	-	22:30 (米)1月ニューヨーク連銀製造業景気指数	11.5

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	▲0.086	0.001	▲0.058	▲0.099
T/N	-	-	▲0.020	▲0.124
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.024	▲0.132
2W	▲0.035	▲0.020	▲0.032	▲0.133
3W	-	-	-	▲0.137
1M	-	-	-	▲0.140
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.151
6M	-	-	-	▲0.158
1Y	-	-	-	▲0.157

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

週末4日積みとなる本日の無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まった。その後は主に▲0.075%~▲0.030%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比横ばいの▲0.058%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.075		▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

積み最終日となるため、引き続き調達意欲は強く、本日と同様の地合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月11日	1月15日	1月15日	1月16日	1月16日	1月16日
券	+2,500	+2,500	+2,500	+2,000	+2,000	
財政	▲5,300	▲7,900	▲7,900	+1,000	+1,000	
過不足	▲2,800	▲5,400	▲5,400	+3,000	+3,000	
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
共通担保(全店)			▲5,500	+5,100		
CP等買入	▲100		▲300			+2,500
ETF買入		+200		+700		
国債補完供給	+2,300	▲100	+100			
当座預金増減	▲500	▲5,300	▲5,300	+5,500	+5,500	
当座預金残高	3,862,000	3,856,700	3,856,700	3,862,200	3,862,200	
準備預金残高	3,382,900					
積み終了先	3,382,800					
超過準備	3,382,800					
非準預先残高	479,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	96.8%					
乖離率	3.1%					

1月11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
国債補完供給(1/11~1/15)	78,635	36	36	▲0.600	▲0.600	
	9,972	20	20	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(1/15~1/28)	8,000	5,115	5,115			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月10日時点 4,992,900	今積期の所要準備額 3,123,800
	1月15日以降の残り所要積数 100
	平均 100

国庫短期証券入札予定

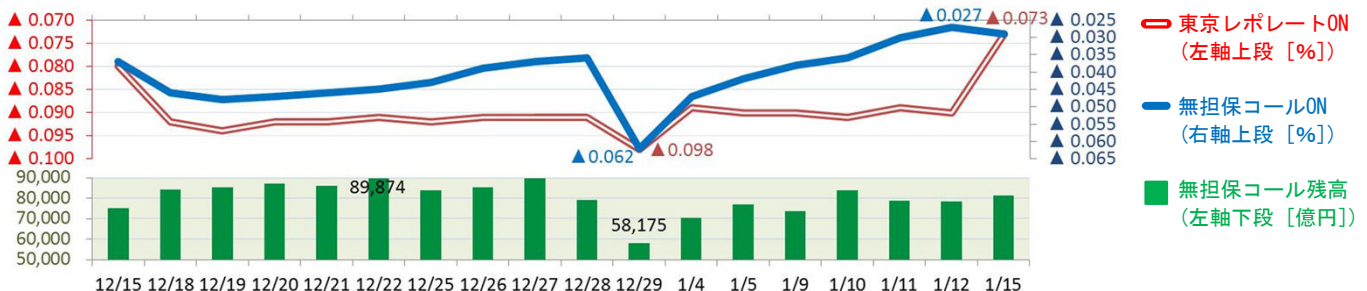
1月17日	1年	第808回
1月18日	3ヶ月	第809回
1月25日	3ヶ月	
2月1日	3ヶ月	

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	12月19日	2
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	7 15 21 28	1月7日	3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	4 9 17 25 30	1月9日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	500	7 15 21 28	1月7日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	1月9日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	12月17日	-

1年前の市場推移 ○2017年12月積み期 [12月15日~1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。