

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月4日(金)

短期市場の推移

	12月25日	12月26日	12月27日	12月28日
加重平均金利	▲0.070	▲0.070	▲0.070	▲0.055
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.101	▲0.101	▲0.098
無コール残	72,036	71,070	72,009	39,941
ON	36,021	34,855	36,714	18,986
その他	36,015	36,215	35,295	20,955
有コール残	21,347	21,412	15,631	25,052

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7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マナターベース(12月)	-	(米)12月ISM非製造業指数	
10:00	営業毎旬報告(12月31日現在)	-	(米)アトランタ連銀総裁講演	
			19:00 (欧)11月小売売上高[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	▲0.086	0.001	▲0.070	▲0.094
T/N	-	-	▲0.020	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.035	▲0.047	▲0.102
2W	▲0.045	▲0.040	▲0.044	▲0.112
3W	-	-	▲0.045	▲0.119
1M	▲0.045	0.200	0.004	▲0.131
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.152
6M	-	-	-	▲0.157
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

本日の無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まり、その後は主に▲0.086%~▲0.055%の水準で取引された。年末初で調達を控えた先が戻ってきたことから、▲0.08%台の出合が増加し、同加重平均金利は前営業日対比▲0.016%の▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

ビッドサイドは厚くなっていくものの、取り上がる動きは限定的であり、引き続き軟調な地合で推移すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月4日	1月7日	1月7日	1月8日	1月8日	1月8日
券	+6,000	+4,200		+4,000		+4,000
財政	▲22,000	▲3,100		▲25,000		▲25,000
過不足	▲16,000	+1,100		▲21,000		▲21,000
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
国債買入				+4,700		
共通担保(全店)						▲1,900
CP等買入			▲700			
ETF買入				+200		
国債補完供給	+700	▲100	+100			
当座預金増減	▲15,400	+5,400		▲22,900		
当座預金残高	3,876,100	3,881,500		3,858,600		
準備預金残高	3,375,700					
積み終了先	3,375,500					
超過準備	3,375,400					
非準備預金残高	500,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	71.0%					
乖離率	28.9%					

1月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(1/7~)						
5~10年	4,300	10,230	4,310	▲0.048	▲0.045	53.8
国債補完供給(1/4~1/7)						
	35,712	112	112	▲0.600	▲0.600	

国庫短期証券入札予定

1月8日	3ヶ月	第805回
1月9日	6ヶ月	第806回
1月11日	3ヶ月	第807回
1月17日	1年	
1月8日	10年	
1月10日	30年	
1月16日	5年	
1月24日	20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	12月25日	4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	4 9 17 25 30	1月4日	4
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	12月27日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	12月19日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	12月17日	1

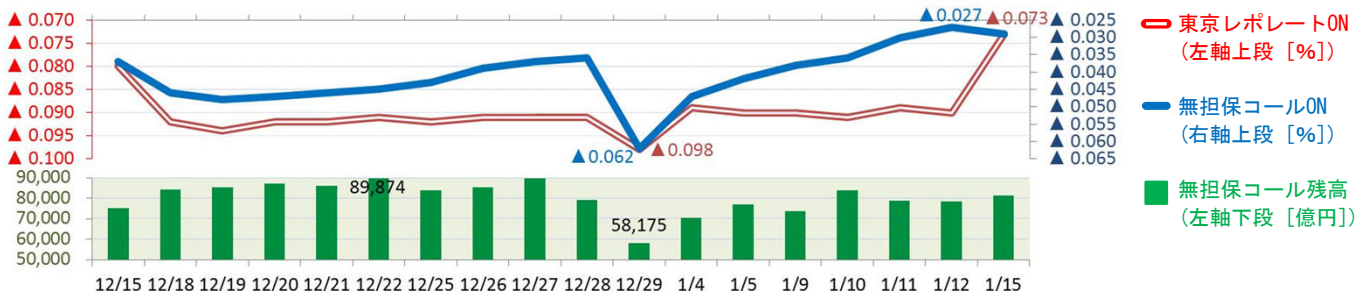
マナターベース [億円]
12月28日時点 5,043,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,118,200
1月7日以降の残り所要積数 1,400
平均 200

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。