

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月8日(火)

## 短期市場の推移

	12月27日	12月28日	1月4日	1月7日
加重平均金利	▲0.070	▲0.055	▲0.070	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.098	▲0.094	▲0.087
無コール残	72,009	39,941	69,957	80,957
ON	36,714	18,986	40,732	49,562
その他	35,295	20,955	29,225	31,395
有コール残	15,631	25,052	34,124	29,835

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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		19:00	(欧)11月失業率
-		-	(米)12月FOMC議事録
-		-	

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	▲0.066	▲0.083
T/N	-	-	▲0.020	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.001	▲0.041	▲0.091
2W	-	-	0.000	▲0.113
3W	-	-	-	▲0.118
1M	-	-	0.000	▲0.128
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.151
6M	-	-	-	▲0.158
1Y	-	-	-	▲0.158

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▲0.085%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比+0.002%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.040

## 翌営業日のマーケット

本日対比でビッドサイドはやや厚くなり、レートは小幅上昇と予想する。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月8日	1月9日	1月9日	1月10日	1月10日	1月10日
券	+4,600	+4,000	+4,000	+3,000		
財政	▲28,200	▲18,700	▲18,700	▲1,000		
過不足	▲23,600	▲14,700	▲14,700	+2,000		
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	+10,400					
共通担保(全店)	▲1,900	+1,800				
CP等買入			▲400			
ETF買入				+700		
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減	▲13,200	▲14,300		+2,000		
当座預金残高	3,868,800	3,854,500		3,856,500		
準備預金残高	3,406,900					
積み終了先	3,406,700					
超過準備	3,406,700					
非準備預金残高	461,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

## 1月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
米ドル資金供給(1/10~1/17)		0	0	2,900	2,900	
国債補完供給(1/8~1/9)	16,139	41	41	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース	所要
1月7日時点 5,023,600	今積期の所要準備額 3,118,200
	1月9日以降の残り所要積数 900
	平均 100

## 国庫短期証券入札予定

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18日	3ヶ月	
1月10日	30年	
1月16日	5年	
1月24日	20年	
1月29日	40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	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	1月7日 3
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

## 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。