

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月10日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月4日	1月7日	1月8日	1月9日
加重平均金利	▲0.070	▲0.068	▲0.066	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.094	▲0.087	▲0.083	▲0.082
無コール残	69,957	80,957	79,937	84,426
ON	40,732	49,562	47,117	51,161
その他	29,225	31,395	32,820	33,265
有コール残	34,124	29,835	32,687	30,054

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11日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	11月国際収支 (経常収支)	5676億円	22:30	(米)12月消費者物価コア指数[前年比]	2.2%
8:50	貸出・預金動向(12月)	-	18:30	(英)11月商品貿易収支	-110億ポンド
			18:30	(英)11月鉱工業生産指数 [前月比]	0.4%

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	▲0.084
T/N	-	-	▲0.020	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.000	▲0.016	▲0.103
2W	-	-	▲0.005	▲0.119
3W	-	-	-	▲0.127
1M	-	-	▲0.045	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
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

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▲0.086%~▲0.035%の水準で取引された。地銀業態を中心に調達意欲が昨日対比で強まり、同加重平均金利は前営業日対比+0.004%の▲0.058%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.073		▲0.075 ~ ▲0.045	▲0.086 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態を中心に調達意欲が強く、堅調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月10日	1月11日	1月15日
券	+2,700	+2,300	+3,000
財政	+3,400	▲9,000	▲14,000
過不足	+6,100	▲6,700	▲11,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲4,700	-	-
共通担保(全店)	-	▲100	▲5,500
CP等買入	▲100	-	-
ETF買入	+600	+200	-
国債補完供給	▲2,300	+2,300	-
当座預金増減	+9,000	▲4,300	▲16,500
当座預金残高	3,862,500	3,858,200	3,841,700
準備預金残高	3,398,600	主な需給要因	
積み終了先	3,398,500	国債発行 (30年)	
超過準備	3,398,400	源泉税揚げ	
非準備預金残高	463,900	国庫短期証券発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.9%	国債償還(2年)	
平均	83.9%		
乖離率	16.0%		

1月10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
CP等買入(1/16~)	2,500	7,887	2,460	▲0.001	0.003	54.5
国債補完供給(1/10~1/11)	185,801	1,764	1,764	▲0.600	▲0.600	
	19,867	492	492	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月9日時点 4,986,500	今積期の所要準備額 3,123,800
	1月11日以降の残り所要積数 400
	平均 100

国庫短期証券入札予定

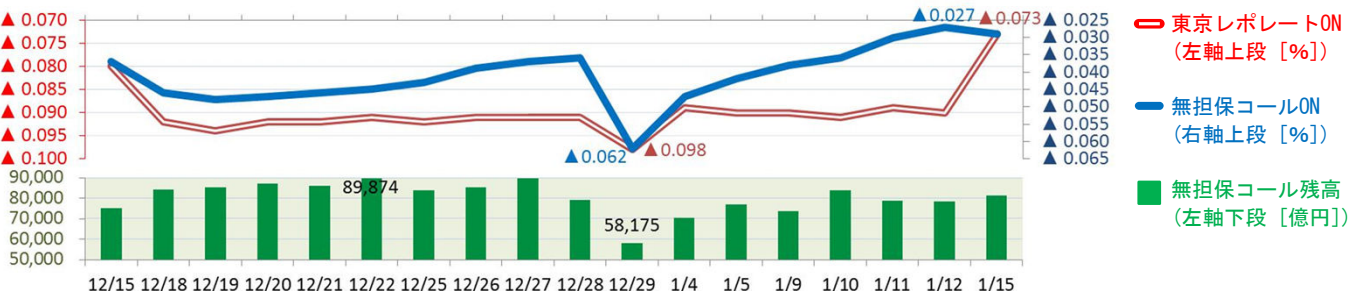
1月11日	3ヶ月	第807回
1月17日	1年	第808回
1月18日	3ヶ月	
1月25日	3ヶ月	
1月16日	5年	
1月24日	20年	
1月29日	40年	
1月31日	2年	

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。