

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月15日(火)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	1月8日	1月9日	1月10日	1月11日
加重平均金利	▲0.066	▲0.062	▲0.058	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.082	▲0.084	▲0.099
無コール残	79,937	84,426	83,350	78,228
ON	47,117	51,161	51,165	47,123
その他	32,820	33,265	32,185	31,105
有コール残	32,687	30,054	24,802	25,968

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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	12月国内企業物価指数 [前年比]	+1.8%	18:30	(英)12月消費者物価コア 指数[前年比]	1.8%
8:50	11月機械受注[前月比]	+3.0%	21:00	(米)MBA住宅ローン 申請指数[前週比]	-
17:00	業態別の日銀当座預金 残高(12月)	-	22:30	(米)12月小売売上高	0.3%

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

## 本日の市況

	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	▲0.062	▲0.096
T/N	-	-	▲0.020	▲0.123
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.020	▲0.036	▲0.127
2W	▲0.045	▲0.035	▲0.040	▲0.132
3W	-	-	-	▲0.138
1M	▲0.016	0.000	▲0.012	▲0.143
2M	-	-	▲0.040	-
3M	-	-	-	▲0.152
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

積み最終日となる本日の無担保コールON物は▲0.080%の都合から始まった。その後は主に、▲0.085%~▲0.03%の水準で出合が見られた。一部で、前営業日よりも調達を控えた先もあり、同加重平均金利は前営業日対比▲0.004%の▲0.062%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080		▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.030

## 翌営業日のマーケット

新積み期に入るため、ビッドサイドは慎重な調達姿勢となると予想する。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月15日	1月16日	1月16日	1月17日	1月17日
券	+2,500	+2,600	+2,600	+1,000	
財政	▲1,800	▲600	▲600	▲18,000	
過不足	+700	+2,000	+2,000	▲17,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+10,400	
共通担保(全店)	▲5,500	+5,100			
CP等買入	▲300		▲100	+2,500	
ETF買入		+700		+100	
国債補完供給	+100	▲1,000	+1,000		
当座預金増減		▲200	+15,900	▲17,000	
当座預金残高		3,861,800	3,877,700	3,860,700	
準備預金残高		3,373,600	主な需給要因		
積み終了先		3,373,600			
超過準備		3,373,500			
非準備先残高		488,200	国債発行(5年)		
準備預金進捗率		100.0%			
平均		100.0%			
乖離率		0.0%			

## 1月15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
国債買入(1/16~)						
1~3年	3,500	8,013	3,505	0.002	0.003	86.3
3~5年	4,000	12,052	4,006	0.001	0.002	15.6
10~25年	2,000	4,879	2,011	0.003	0.004	89.4
25年~	500	1,403	506	0.006	0.007	44.6
米ドル資金供給(1/17~1/25)		1	1	2.900	2.900	
国債補完供給(1/15~1/16)		206,383	968	968	▲0.600	▲0.600

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月11日時点 4,989,900	来積期の所要準備額 3,140,800
	1月16日以降の残り所要積数 3,140,800
	平均 101,300

## 国庫短期証券入札予定

## 今月の国債買入オペ予定

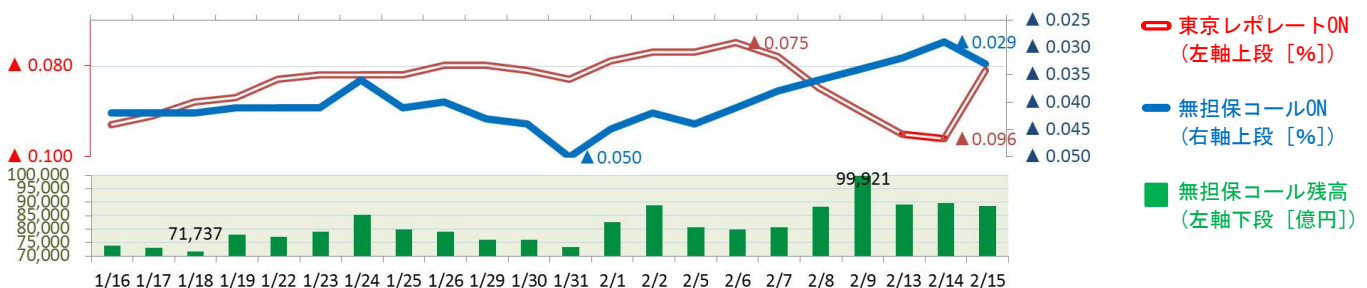
1月17日	1年	第808回
1月18日	3ヶ月	第809回
1月25日	3ヶ月	
2月1日	3ヶ月	
国債入札予定		
1月16日	5年	
1月24日	20年	
1月29日	40年	
1月31日	2年	

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		1月15日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300		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		1月15日	2
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

○2018年1月積み期 [1月16日~2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。