

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月17日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月10日	1月11日	1月15日	1月16日
加重平均金利	▲0.058	▲0.058	▲0.062	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.099	▲0.096	▲0.182
無コール残	83,350	78,228	83,384	74,887
ON	51,165	47,123	53,894	44,977
その他	32,185	31,105	29,490	29,910
有コール残	24,802	25,968	25,327	13,387

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18日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	12月のCPI[前年比]	+0.8%	23:15	(米)12月鉱工業生産指数[前月比] 0.3%
13:30	11月の鉱工業生産確報			ウリアムズNY連銀 総裁の講演
				1月のシカゴ大消費者信頼感速報

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	▲0.141
T/N	-	-	▲0.020	▲0.154
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.035	▲0.039	▲0.151
2W	-	-	▲0.040	▲0.152
3W	-	-	-	▲0.152
1M	-	-	▲0.020	▲0.153
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.156
6M	-	-	-	▲0.160
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

無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まった。その後は主に、▲0.086%~▲0.035%の水準で出合が見られた。一部、試し取りによる+0.001%の出合が見られたこともあり、同加重平均金利は前営業日対比+0.006%の▲0.062%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるものの、取りあがる動きにはならず、軟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17日	1月18日	1月18日	1月19日	1月21日	1月22日
券	+1,500	+1,400	+1,400	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲19,100	▲500	▲500	▲17,000	▲17,000	▲17,000
過不足	▲17,600	+900	+900	▲16,000	▲16,000	▲16,000
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
国庫短期証券買入		+5,000				
国債買入			+4,900			
共通担保(全店)				▲1,800		
CP等買入	▲200		▲200		+2,500	
ETF買入			+300			
国債補完供給	▲400		+400			
当座預金増減	▲13,200	+6,300	+6,300	▲15,300	▲15,300	▲15,300
当座預金残高	3,864,600	3,870,900	3,870,900	3,855,600	3,855,600	3,855,600
準備預金残高	3,365,600					
積み終了先	3,266,200					
超過準備	2,839,900					
非準備預金残高	499,000					
準備預金進捗率	95.7%					
平均	6.5%					
乖離率	89.3%					

1月17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(1/18~)						
~1年	500	2,017	500	0.002	0.002	97.0
5~10年	4,300	9,539	4,312	▲0.002	0.000	2.5
国債補完供給(1/17~1/18)						
	36,143	345	345	▲0.600	▲0.600	

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

1月18日	3ヶ月	第809回
1月25日	3ヶ月	
2月1日	3ヶ月	
2月7日	6ヶ月	
1月24日	20年	
1月29日	40年	
1月31日	2年	
2月5日	10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	1月17日	1
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17日	2
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	-

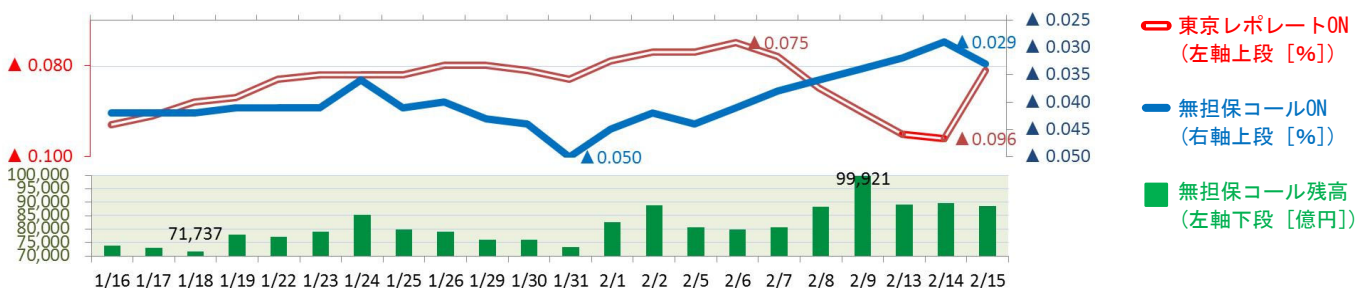
マナタリーベース [億円]
1月16日時点 5,000,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,140,800
1月18日以降の残り所要積数 133,900
平均 4,600

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。