

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月22日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月16日	1月17日	1月18日	1月21日
加重平均金利	▲0.068	▲0.062	▲0.067	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.182	▲0.141	▲0.146	▲0.119
無コール残	74,887	86,309	80,128	78,351
ON	44,977	55,429	49,898	47,411
その他	29,910	30,880	30,230	30,940
有コール残	13,387	13,692	13,165	14,004

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23日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
-	日銀金融政策決定会合	▲0.1%	21:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
-	経済・物価情勢の展望	-		(米)11月のFHFA住宅価格指数
	黒田日銀総裁の講演			

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	▲0.150	0.001	▲0.067	▲0.117
T/N	-	-	▲0.020	▲0.144
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.230	▲0.026	▲0.145
2W	▲0.040	0.000	▲0.015	▲0.149
3W	-	-	-	▲0.150
1M	-	-	-	▲0.152
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.159
6M	-	-	-	▲0.160
1Y	-	-	-	▲0.160

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。昨日と同様軟調な地合となり、同加重平均金利は前営業日対比横ばいの▲0.067%だった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続きビッドは薄く、軟調な地合が継続すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月22日	1月23日	1月23日	1月24日	1月24日	1月25日
券	+800	+400	+400	+0	+0	+0
財政	+2,600	▲4,900	▲4,900	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	+3,400	▲4,500	▲4,500	+1,000	+1,000	+1,000
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		+10,300				
CP等買入	▲100		▲200			
ETF買入		+500				
当座預金増減	+14,100	+300	+300	+1,000	+1,000	+1,000
当座預金残高	3,867,500	3,867,800	3,867,800	3,868,800	3,868,800	3,868,800
準備預金残高	3,363,700	主な需給要因				
積み終了先	3,361,000					
超過準備	3,359,700					
非準預先残高	503,800					
準備預金進捗率	99.5%					
平均	22.6%					
乖離率	76.9%					

1月22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
国庫短期証券買入(1/23~)	5,000	19,404	5,002	0.003	0.010	63.5
国債補完供給(1/22~1/23)	31,000	39	39	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月21日時点 4,971,700	今積期の所要準備額 3,140,800
	1月23日以降の残り所要積数 15,800
	平均 700

国庫短期証券入札予定

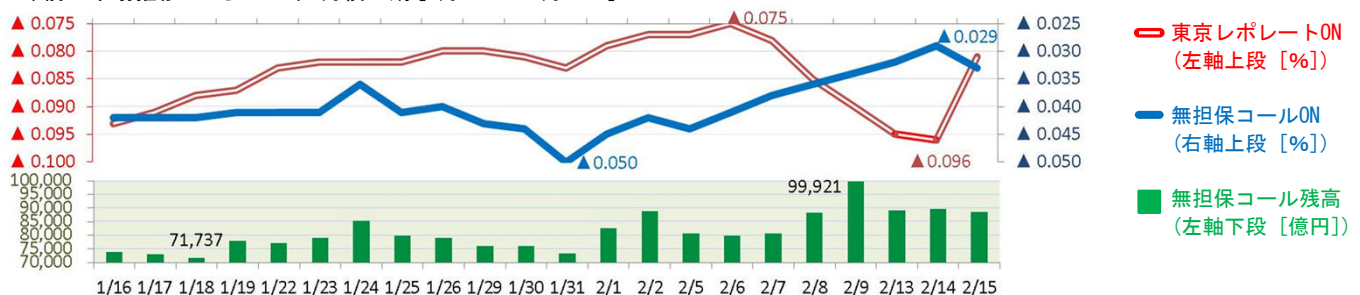
今月の国債買入オペ予定

1月25日	3ヶ月	第810回
2月1日	3ヶ月	
2月7日	6ヶ月	
2月8日	3ヶ月	
国債入札予定		
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	7 15 21 28	1月21日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	4 9 17 25 30	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	7 15 21 28	1月21日	1
物価運動債	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。