

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月23日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月17日	1月18日	1月21日	1月22日
加重平均金利	▲0.062	▲0.067	▲0.067	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.141	▲0.146	▲0.119	▲0.117
無コール残	86,309	80,128	78,351	79,473
ON	55,429	49,898	47,411	47,988
その他	30,880	30,230	30,940	31,485
有コール残	13,692	13,165	14,004	13,724

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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00 経済・物価情勢の展望 (1月、全文)	-	18:00 (欧)1月購買担当者総合指数(PMI)	51.3
- 【記者会見】黒田総裁 (1月23日)	-	21:45 (欧)1月欧中銀(ECB)政策金利	0.0%
-	-	23:45 (米)1月製造業PMI	-

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	▲0.067	▲0.119
T/N	▲0.020	0.000	▲0.016	▲0.142
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.015	▲0.028	▲0.142
2W	▲0.020	▲0.012	▲0.020	▲0.146
3W	-	-	▲0.020	▲0.146
1M	-	-	-	▲0.150
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.158
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%~▲0.030%の水準で出合が見られた。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	▲0.083 ~ ▲0.075	▲0.086 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続きビッドは薄く、本日と同様の軟調な地合が継続すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月23日	1月24日	1月23日	1月24日	1月25日	1月26日
券		+400		▲100		+0
財政		▲7,500		▲2,000		▲4,000
過不足		▲7,100		▲2,100		▲4,000
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				
CP等買入	▲200		▲100			
ETF買入				+300		
国債補完供給		▲100		+100		
当座預金増減		▲2,400		▲1,800		▲4,000
当座預金残高		3,865,100		3,863,300		3,859,300
準備預金残高		3,362,500		主な需給要因		
積み終了先		3,359,700				
超過準備		3,359,700				
非準備預金残高		502,600				
準備預金進捗率		99.6%				
平均		25.8%				
乖離率		73.8%				

1月23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
米ドル資金供給(1/25~1/31)		2	2	2,900	2,900	
国債補完供給(1/23~1/24)	5,151	97	97	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月22日時点 4,985,000	今積期の所要準備額 3,140,800
	1月24日以降の残り所要積数 13,000
	平均 600

国庫短期証券入札予定

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	

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	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。