

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月29日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月23日	1月24日	1月25日	1月28日
加重平均金利	▲0.067	▲0.066	▲0.063	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.119	▲0.108	▲0.111	▲0.108
無コール残	82,821	82,776	80,872	77,083
ON	50,601	49,026	47,592	44,413
その他	32,220	33,750	33,280	32,670
有コール残	14,252	16,661	15,769	24,928

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。無コール残は無担保・有担保コール残高の意。

1月30日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	預金種類別店頭表示金利の平均年利率等	-	FOMCの結果
8:50	製造業部門別投入・産出物価指数(12月)	-	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
-	-	22:30	(米)10-12月期GDP速報値[前期比年率]
-	-	-	2.5%

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	▲0.064	▲0.119
T/N	-	-	▲0.020	▲0.128
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.127
2W	-	-	▲0.029	▲0.126
3W	-	-	-	▲0.131
1M	▲0.025	0.020	▲0.023	▲0.136
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.155
6M	-	-	-	▲0.159
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

本日の無担保コールON物は▲0.08%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▲0.002%の▲0.064%となった。

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

翌営業日のマーケット

ビッドサイドに大きな変化は見られず、本日と同様の地合いを予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月29日	1月30日	1月30日	1月31日	1月31日	1月31日
券	+100	+700	+700	▲400	▲400	▲400
財政	▲2,900	▲3,300	▲3,300	▲1,500	▲1,500	▲1,500
過不足	▲2,800	▲2,600	▲2,600	▲1,900	▲1,900	▲1,900
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				+2,500		+2,500
国債買入		+10,400				
CP等買入	▲200		▲200			+2,500
社債等買入				+800		
ETF買入		+200				
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減	+7,500	+600	+600	+600	+600	+600
当座預金残高	3,884,200	3,884,800	3,884,800	3,885,400	3,885,400	3,885,400
準備預金残高	3,386,700					
積み終了先	3,385,500					
超過準備	3,385,500					
非準備預金残高	497,500					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	45.2%					
乖離率	54.6%					

1月29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(1/30~)	2,500	12,547	2,503	0.036	0.046	3.5
米ドル資金供給(1/31~2/7)		1	1	2.900	2.900	
国債補完供給(1/29~1/30)	26,909	1	1	▲0.600	▲0.600	
	10,068	137	137	▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給用担保国債供給(1/30~2/8)	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]
1月28日時点 4,993,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,140,800
1月30日以降の残り所要積数 6,200
平均 400

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

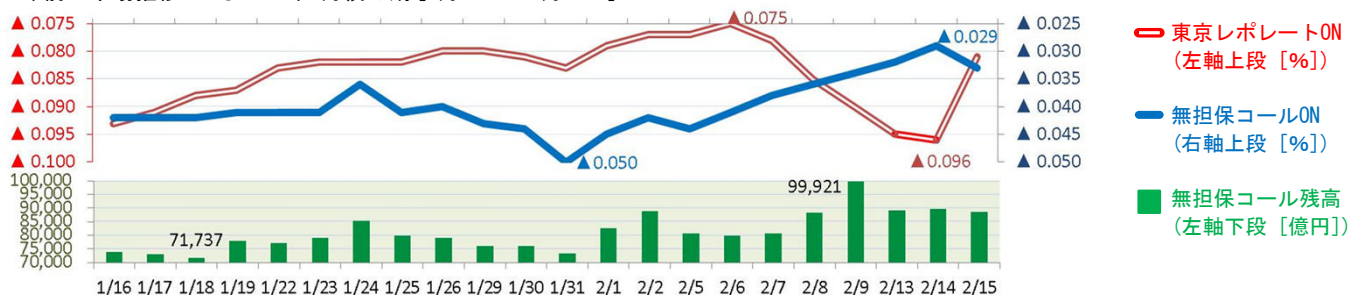
2月1日	3ヶ月	第811回
2月7日	6ヶ月	
2月8日	3ヶ月	
2月15日	3ヶ月	
1月31日	2年	
2月5日	10年	
2月7日	30年	
2月13日	5年	

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25日	1
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
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	1月25日	0
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。