

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月31日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

2月1日の予定 (時刻は日本時間)

	1月25日	1月28日	1月29日	1月30日
加重平均金利	▲0.063	▲0.062	▲0.064	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.111	▲0.108	▲0.119	▲0.109
無コール残	80,872	77,083	77,778	78,609
ON	47,592	44,413	45,718	46,349
その他	33,280	32,670	32,060	32,260
有コール残	15,769	24,928	18,187	21,147

日本		予想	海外		予想
8:30	12月有効求人倍率	1.63倍	19:00	(欧)1月消費者物価コア指数[前年比]	1.0%
8:30	12月失業率	+2.5%	22:30	(米)1月非農業部門雇用者数	16.3万人
-	【記者会見】雨宮副総裁(1月31日)	-	22:30	(米)1月失業率	3.7%

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。

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

[%]

	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	▲0.060	▲0.100
T/N	-	-	▲0.020	▲0.108
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.047	▲0.017	▲0.026	▲0.113
2W	▲0.037	▲0.010	▲0.025	▲0.114
3W	-	-	-	▲0.121
1M	-	-	-	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
6M	-	-	-	▲0.160
1Y	-	-	-	▲0.159

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.08%の合出から始まった。その後は主に、▲0.086%~▲0.030%の水準で合出が見られた。昨日よりも▲0.08%台のビッドが薄く、その水準の取引量が減ったことから、同加重平均金利は集計上の技術的要因から前営業日対比+0.003%の▲0.060%となった。

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

翌営業日のマーケット

月末に調達を控えた先のビッドが戻る見込みであることから、本日対比では取引量が多くなると予想する。

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月31日	2月1日	2月1日	2月4日	2月4日	2月4日
券		▲200	+400	+1,000		
財政		▲3,200	▲28,300	▲77,000		
過不足		▲3,400	▲27,900	▲76,000		
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
国債買入		+4,900				
共通担保(全店)				▲1,700		
CP等買入	▲1,100	+2,500	▲100			
社債等買入	▲100					
ETF買入		+1,200				
国債補完供給		▲200	+200			
当座預金増減		+3,800	▲27,800	▲77,700		
当座預金残高		3,887,200	3,859,400	3,781,700		
準備預金残高		3,385,100	主な需給要因			
積み終了先		3,383,900				
超過準備		3,383,900				
非準備預金残高		502,100	国債発行(2年)	税・保険揚げ		
準備預金進捗率		99.9%	国庫短期証券(3M)発行償還			
平均		51.6%				
乖離率		48.3%				

1月31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 按分

国債補完供給(1/31~2/1)						
	117,525	198	198	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月30日時点 4,999,200	今積期の所要準備額 3,134,800
	2月1日以降の残り所要積数 3,800
	平均 300

国庫短期証券入札予定

来月の国債買入オペ予定

[億円]

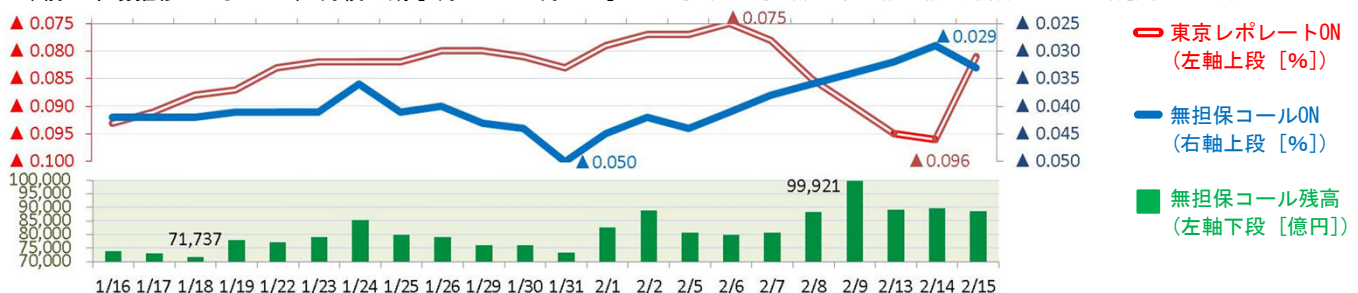
2月1日	3ヶ月	第811回
2月7日	6ヶ月	第812回
2月8日	3ヶ月	
2月15日	3ヶ月	
国債入札予定		
2月5日	10年	
2月7日	30年	
2月13日	5年	
2月15日	物価連動	

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	2月2回程度	1月30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	4 8 18 27	1月28日	4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	6 8 14 22 27	1月30日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	500	4 12 18 22	1月28日	4
物価連動債	250 程度	250	2月2回程度	1月25日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	12月17日	1

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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会