

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年12月28日(金)

短期市場の推移

[億円] [%]

	12月21日	12月25日	12月26日	12月27日
加重平均金利	▲0.071	▲0.070	▲0.070	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.156	▲0.101	▲0.101	▲0.101
無コール残	76,152	72,036	71,070	72,009
ON	39,807	36,021	34,855	36,714
その他	36,345	36,015	36,215	35,295
有コール残	12,395	21,347	21,412	15,631

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4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(12月実績)	0:00	(米)12月ISM製造業景況指数
-	-	22:30	(米)12月非農業部門雇用者数
-	-	22:30	(米)12月失業率

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	▲0.054	▲0.098
T/N	▲0.086	▲0.020	▲0.075	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.105
2W	▲0.050	▲0.035	▲0.048	▲0.112
3W	-	-	-	▲0.120
1M	0.360	0.480	0.420	▲0.130
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.153
6M	-	-	-	▲0.157
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

本日の市況

年末初物となる無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.055%の水準で取引された。四半期末かつ、7日積となるため、調達を控える先が多く、昨日対比▲0.08%台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+0.016%の▲0.054%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

年末初で調達を控えたビッドが戻ってくる見込みであるものの、慎重な動き出しとなる事が予想されるため、引続き軟調な地合いで推移すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月28日	1月4日	1月7日
券	▲2,600	+6,100	+4,000
財政	▲3,400	▲23,900	▲1,000
過不足	▲6,000	▲17,800	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,100		
CP等買入	▲3,300	+2,000	
ETF買入	+700		
国債補完供給	▲700	+700	
当座預金増減	▲200	▲17,100	+3,000
当座預金残高	3,891,500	3,874,400	3,877,400
準備預金残高	3,376,900	主な需給要因	
積み終了先	3,376,700		
超過準備	3,376,100		
非準備先残高	514,600	国債発行(2年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	61.3%		
乖離率	38.6%		

12月28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

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月27日時点 5,041,200	今積期の所要準備額 3,118,200
	1月4日以降の残り所要積数 2,200
	平均 200

国庫短期証券入札予定

1月8日	3ヶ月	第805回
1月9日	6ヶ月	第806回
1月11日	3ヶ月	
1月17日	1年	
1月8日	10年	
1月10日	30年	
1月16日	5年	
1月24日	20年	

来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	12月19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	7 15 21 28	12月25日	4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	4 9 17 25 30	12月27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	7 15 21 28	12月27日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	12月19日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	12月17日	0

1年前の市場推移

○2017年12月積み期 [12月15日~1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。