

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年7月9日(月)

## 短期市場の推移

	7月3日	7月4日	7月5日	7月6日
加重平均金利	▲0.073	▲0.073	▲0.072	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.099	▲0.097	▲0.100	▲0.094
無コール残	75,261	79,370	80,846	74,870
ON	47,381	50,330	50,731	44,955
その他	27,880	29,040	30,115	29,915
有コール残	24,442	27,722	24,201	30,405

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。

## 7月10日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック(6月)	-	10:30	(中)6月消費者物価指数[前年比] 2.0%
	-		10:30	(中)6月生産者物価指数[前年比] 4.4%
	-		17:30	(英)5月鉱工業生産指数[前月比] 0.8%

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	▲0.071	▲0.085
T/N	-	-	0.000	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.032	▲0.030	▲0.031	▲0.094
2W	-	-	▲0.055	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	-	▲0.116
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.148
1Y	-	-	-	▲0.157

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

無担保コールON物は▲0.080%の出合から始まり、その後は▲0.086~▲0.05%のレンジで取引された。前営業日に比べ▲0.08%台での出合が多くみられたため、同加重平均金利は前営業日対比▲0.002%の▲0.071%となった。

## O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.050

## 翌営業日のマーケット

積み最終日に向けて調達意欲は強まってくると予想されるため、出合レンジも小幅上昇方向と思われる。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月9日	7月10日	7月10日	7月11日	7月11日	7月11日
券	+1,100	+100	+100	+0	+0	
財政	+2,300	▲1,900	▲1,900	▲28,000	▲28,000	
過不足	+3,400	▲1,800	▲1,800	▲28,000	▲28,000	
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		+8,600				
共通担保(全店)	▲1,400	+1,300				
CP等買入	▲200		▲100	+2,000		
国債補完供給	+1,200	▲200	+200			
当座預金増減	+12,700	+300	+300	▲28,000	▲28,000	
当座預金残高	3,884,300	3,884,600	3,884,600	3,856,600	3,856,600	
準備預金残高	3,421,900					
積み終了先	3,421,700					
超過準備	3,421,700					
非準備預金残高	462,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	80.0%					
乖離率	19.9%					

## 7月9日のオペ結果 [%(億)] ※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
国債補完供給(7/9~7/10)	18,103	139	139	▲0.600	▲0.600	
	2,287	8	8	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]  
7月6日時点 4,964,500

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,031,300  
7月10日以降の残り所要積数 800  
平均 100

## 国庫短期証券入札予定

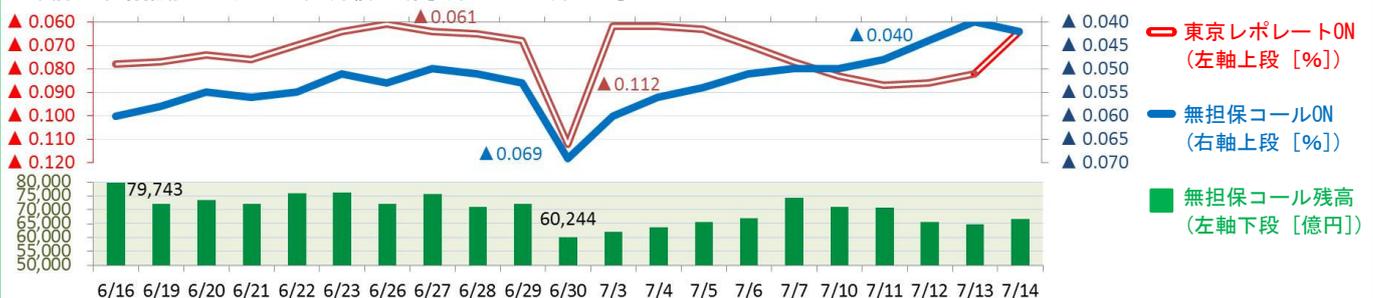
7月13日	3ヶ月	第770回
7月19日	1年	
7月20日	3ヶ月	
7月27日	3ヶ月	
7月10日	5年	
7月12日	20年	
7月24日	40年	
7月26日	2年	

## 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	7月2日	1
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	4 6 11 17 23 27	7月6日	4
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 11 13 19 25 27	7月4日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900			
25年超	500~1,500 程度	700	2 6 13 19 25	7月6日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	7月2日	1
変動利付償<偶数月>	1,000 程度	1,000		6月8日	-

## 1年前の市場推移

○2017年6月積み期 [6月16日~7月14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。