

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年7月1日(月)

短期市場の推移

	6月25日	6月26日	6月27日	6月28日
加重平均金利	▲0.066	▲0.068	▲0.070	▲0.076
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.086	▲0.085	▲0.088
無コール残	99,155	94,762	96,207	55,487
ON	62,885	52,452	54,547	36,307
その他	36,270	42,310	41,660	19,180
有コール残	23,877	26,774	31,479	21,553

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2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マナターベース(6月)	-	(米)NY連銀総裁の講演	-
8:50	短観(6月業種別計数、「企業の物価見通し」の概要)	-	18:00 (欧)5月PPI[前年比]	-
10:00	営業毎旬報告(6月30日現在)	-	-	-

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	▲0.150	0.001	▲0.071	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	▲0.040	▲0.067	▲0.086
2W	▲0.075	0.000	▲0.062	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.096
1M	▲0.045	▲0.020	▲0.027	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.150
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

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.075%の合出から始まり、その後は主に▲0.075~▲0.070%のレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.071%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、合出の水準は本日と横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月1日	7月2日	7月1日	7月2日	7月3日	7月4日
券		+600		+800		+0
財政		▲25,700		▲5,100		▲47,000
過不足		▲25,100		▲4,300		▲47,000
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		+7,800				
共通担保(全店)	▲600	+700				
ETF買入				+300		
当座預金増減		▲17,200		▲4,000		▲47,000
当座預金残高		4,090,700		4,086,700		4,039,700
準備預金残高		3,584,200	主な需給要因			
積み終了先		3,584,000				
超過準備		3,584,000				
非準備先残高		506,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		53.3%				
乖離率		46.6%				

7月1日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(7/1~7/2)	18,641	2	2	▲0.350	▲0.350	

マナターベース [億円]
6月28日時点 5,233,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,083,000
7月2日以降の残り所要
積数 2,800
平均 200

国庫短期証券入札予定

7月5日	3ヶ月	第842回
7月9日	6ヶ月	
7月12日	3ヶ月	
7月18日	1年	
7月2日	10年	
7月4日	30年	
7月9日	5年	
7月17日	20年	

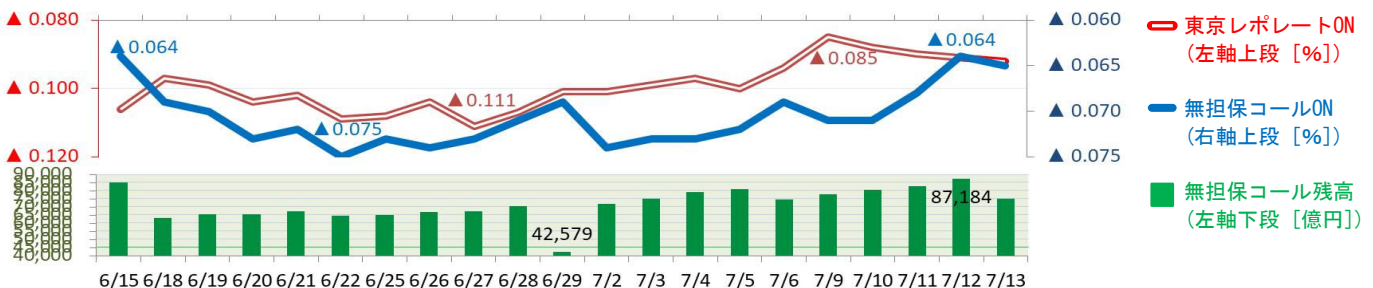
今月の国債買入オペ予定

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	6月19日	2
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	3,500			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	4,000	3 12 22 31	6月26日	4
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 22 31	6月28日	4
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	400	3 12 26	6月28日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	6月26日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	6月14日	-

1年前の市場推移

○2018年6月積み期 [6月15日~7月13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。