

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年7月2日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月26日	6月27日	6月28日	7月1日
加重平均金利	▲0.068	▲0.070	▲0.076	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.086	▲0.085	▲0.088	▲0.091
無コール残	94,762	96,207	55,487	83,488
ON	52,452	54,547	36,307	56,133
その他	42,310	41,660	19,180	27,355
有コール残	26,774	31,479	21,553	21,695

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3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	日銀当座預金増減要因 (7月見込み)	-	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
10:30	【挨拶】布野審議委員 (広島)	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
14:00	需給ギャップと潜在成長率	-	23:00	(米)6月ISM非製造業景況指数	56.0

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	▲0.085	0.001	▲0.071	▲0.089
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.000	▲0.088
2W	▲0.075	▲0.015	▲0.038	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.098
1M	-	-	▲0.010	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.125
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%の出合から始まり、その後は主に▲0.08~▲0.07%のレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.071%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.085 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

税揚げ要因により、出合の水準は本日よりも若干上昇すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月2日	7月3日	7月4日
券	+600	+400	+0
財政	▲9,000	▲45,700	▲1,000
過不足	▲8,400	▲45,300	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+2,500	
ETF買入	+300		
当座預金増減	▲8,100	▲42,800	▲1,000
当座預金残高	4,082,600	4,039,800	4,038,800
準備預金残高	3,567,900	主な需給要因	
積み終了先	3,567,700	法人税・消費税・保険揚げ	
超過準備	3,567,700	国債発行(10年)	
非準備預金残高	514,700	年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	56.7%		
乖離率	43.2%		

7月2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(7/3~)	2,500	12,469	2,500	0.016	0.017	
米ドル資金供給(7/5~7/11)		0	0	2.870	2.870	
国債補完供給(7/2~7/3)	169,289	20	20	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
7月1日時点 5,215,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,083,000
7月3日以降の残り所要積数 2,600
平均 200

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

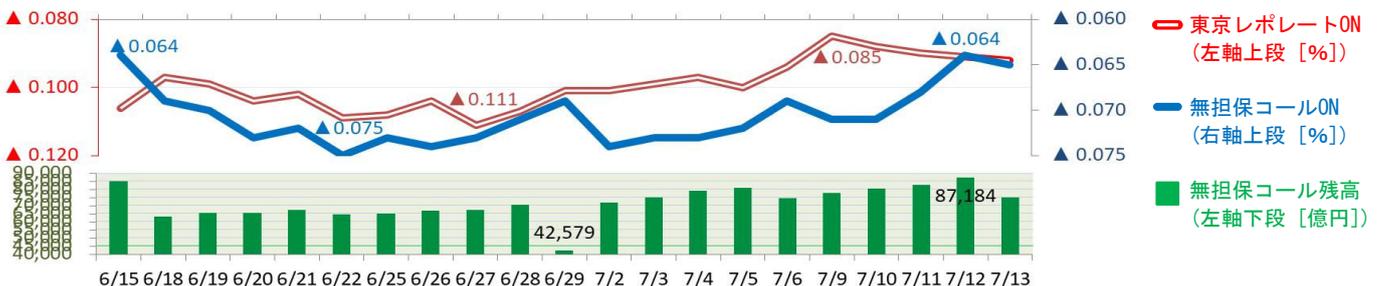
7月5日	3ヶ月	第842回
7月9日	6ヶ月	第843回
7月12日	3ヶ月	
7月18日	1年	
7月4日	30年	
7月9日	5年	
7月17日	20年	
7月23日	40年	

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	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
物価運動債	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	-	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。

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