DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社
TEL:0120-327-017

2019年7月4日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月28日	7月1日	7月2日	7月3日
加重平均金利	▲0.076	▲0.071	▲0.071	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.091	▲0.089	▲0.083
無コール残	55,487	83,488	84,423	108,156
ON	36,307	56,133	52,223	51,320
その他	19,180	27,355	32,200	56,836
有コール残	21,553	21,695	23,056	23,851

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5日の予定（時刻は日本時間）

日本		予想	海外		予想
8:50	マネタリーベースと日本銀行の取引(6月)	−	21:30	(米)6月非農業部門雇用者数	16.0万人
15:00	コール市場残高(6月)	−	21:30	(米)6月失業率	3.6%
	−			−	

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	▲0.072	▲0.082
T/N	−	−	▲0.065	▲0.082
S/N	−	−	−	−
1W	▲0.075	▲0.025	▲0.040	▲0.084
2W	▲0.025	▲0.015	▲0.018	▲0.090
3W	−	−	−	▲0.098
1M	−	−	−	▲0.105
2M	−	−	−	−
3M	−	−	−	▲0.124
6M	−	−	−	▲0.150
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

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～▲0.075%のレンジで取引された。
昨日と比べて地合に大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)は
前営業日対比▲0.001%の▲0.072%となった。

[%]

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

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、出合の水準は本日と横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月4日		7月5日		7月8日	
券		▲700		+400		+1,000
財政		▲1,100		▲4,700		+3,000
過不足		▲1,800		▲4,300		+4,000
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		+10,400				
共通担保(全店)					▲3,700	
CP等買入	▲100		▲200			
国債補完供給	+300	▲400	+400			
当座預金増減		+8,400		▲4,100		+300
当座預金残高		4,047,800		4,043,700		4,044,000
準備預金残高		3,542,000	主な需給要因			
積み終了先		3,541,700				
超過準備		3,541,700				
非準預先残高		505,800	国債発行（30年）		国庫短期証券発行・償還（3M）	
準備預金進捗率		99.9%				
平均		63.3%				
乖離率		36.6%				

7月4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(7/4～7/5)						
	253,198	58	58	▲0.350	▲0.350	
	32,779	337	337	▲0.350	▲0.350	

マネタリーベース [億円]

7月3日時点	5,163,700

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,083,000
7月5日以降の残り所要	
積数	2,000
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	第843回
7月12日	3ヶ月	
7月18日	1年	

国債入札予定

7月9日	5年
7月17日	20年
7月23日	40年
7月25日	2年

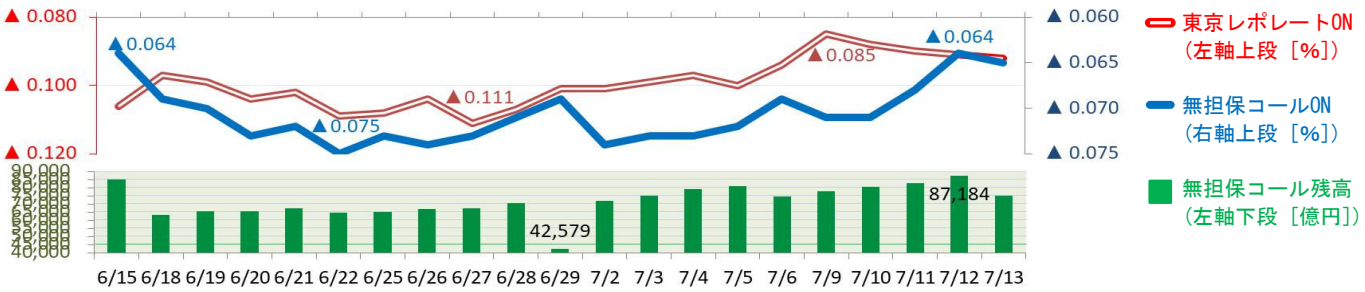
今月の国債買入オペ予定

[億円]

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	3,800	3	12	22	31			7月3日	3
3年超5年以下	2,500～5,000 程度	3,800								
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	1,800	3	12	26				7月3日	2
25年超	100～1,000 程度	400								
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	−						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(登金)第 243号　加入協会 日本証券業協会