

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年7月5日(金)

短期市場の推移

	7月1日	7月2日	7月3日	7月4日
加重平均金利	▲0.071	▲0.071	▲0.071	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.089	▲0.083	▲0.082
無コール残	83,488	84,423	84,305	90,145
ON	56,133	52,223	51,320	54,070
その他	27,355	32,200	32,985	36,075
有コール残	21,695	23,056	23,851	23,463

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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	5月国際収支(経常収支)	16261億円	15:00	(独)5月鉱工業生産指数 [前年比]	-3.2%
9:30頃	【挨拶】黒田総裁 (支店長会議)	-		-	
14:00	地域経済報告(7月)	-		-	

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	▲0.074	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.113
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	0.000	▲0.055	▲0.108
2W	-	-	-	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.112
1M	-	-	▲0.020	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
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、▲0.08%の出合から始まり、その後は主に▲0.085~▲0.075%の水準で取引された。昨日と比べて大手行が調達水準を低下させたことで、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.074%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.060

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月5日	7月8日	7月8日	7月9日	7月9日	7月9日
券		+600	+1,200	+0		
財政		▲5,300	+8,200	+3,000		
過不足		▲4,700	+9,400	+3,000		
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				+5,800		
共通担保(全店)			▲3,700	+2,600		
CP等買入	▲200		▲100			
国債補完供給	+400	▲700	+700			
当座預金増減		▲5,200	+14,700	+3,000		
当座預金残高		4,042,600	4,057,300	4,060,300		
準備預金残高		3,537,200				
積み終了先		3,536,900				
超過準備		3,536,900				
非準備預金残高		505,400				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		73.3%				
乖離率		26.6%				

7月5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
国債買入(7/8~)						
~1年	500	2,092	500	0.023	0.026	78.7
5~10年	4,800	15,880	4,814	▲0.012	▲0.010	43.7
物価連動	250	1,281	250	▲0.180	▲0.180	
国債補完供給(7/5~7/8)						
	310,830	682	682	▲0.350	▲0.350	
共通担保(全店)(7/8~7/22)						
	15,000	2,556	2,556			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
7月4日時点 5,172,800	今積期の所要準備額 3,088,800
	7月8日以降の残り所要積数 1,300
	平均 200

国庫短期証券入札予定

7月9日	6ヶ月	第843回
7月12日	3ヶ月	第844回
7月18日	1年	
7月19日	3ヶ月	
7月9日	5年	
7月17日	20年	
7月23日	40年	
7月25日	2年	

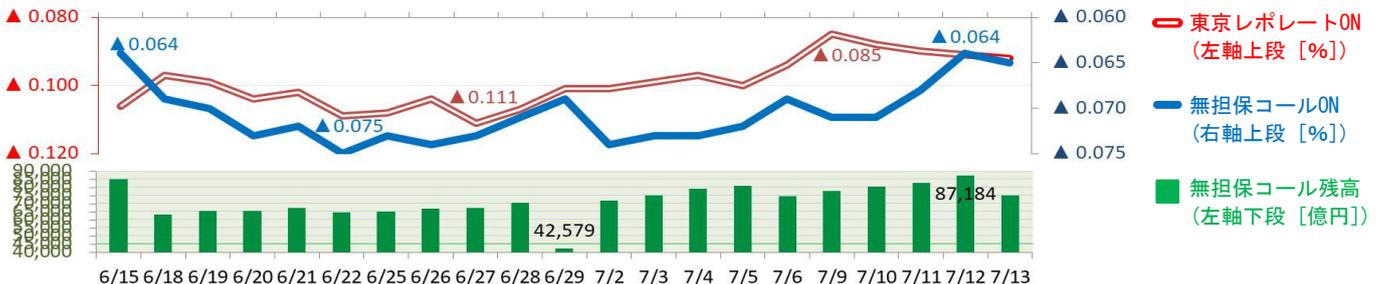
今月の国債買入オペ予定

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5日	1
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	3,800			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,800	3 12 22 31	7月3日	3
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 22 31	7月5日	3
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	400	3 12 26	7月3日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	7月5日	1
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