

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年7月11日(木)

## 短期市場の推移

	7月5日	7月8日	7月9日	7月10日
加重平均金利	▲0.074	▲0.075	▲0.076	▲0.077
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.115	▲0.110	▲0.100
無コール残	85,810	80,280	78,903	79,201
ON	50,270	45,165	41,513	40,701
その他	35,540	35,115	37,390	38,500
有コール残	21,772	18,492	18,377	22,739

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12日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (7月10日現在)	-	18:00 (欧)5月鉱工業生産指数 [前月比]	0.2%
17:00頃	日本銀行が保有する国 債の銘柄別残高	-	21:30 (米)6月生産者物価 コア指数[前年比]	-
17:00頃	日本銀行による国庫短期 証券の銘柄別買入額	-	-	-

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	▲0.076	▲0.103
T/N	-	-	▲0.020	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	0.230	▲0.025	▲0.106
2W	▲0.065	▲0.060	▲0.064	▲0.107
3W	-	-	-	▲0.109
1M	-	-	-	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.126
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.160

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、▲0.085%の出合から始まり、その後は主に▲0.086~▲0.08%の水準で取引された。一部で調達を増やした先も散見されたことで同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.076%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.060

## 翌営業日のマーケット

積最終日であるが、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 7月11日	日銀予想 7月12日	当社需給予想 7月16日
券	▲900	▲200	+1,000
財政	▲5,600	▲27,000	+4,000
過不足	▲6,500	▲27,200	+5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+5,000
共通担保(全店)			
CP等買入	▲100	▲200	+2,000
社債等買入		▲100	
国債補完供給	+100	+100	
当座預金増減	▲6,600	▲20,400	+4,300
当座預金残高	4,027,600	4,007,200	4,011,500
準備預金残高	3,513,100	主な需給要因	
積み終了先	3,513,000	源泉税揚げ	
超過準備	3,513,000	国債償還(2年)	
非準備預金残高	514,500	国庫短期証券発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.9%	マナタリーベース [億円]	
平均	86.7%	7月10日時点 5,156,700	
乖離率	13.2%	所要 [億円]	

## 7月11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(7/12~)	5,000	18,064	5,003	0.005	0.009	45.4
国債補完供給(7/11~7/12)	22,473	85	85	▲0.350	▲0.350	

## 国庫短期証券入札予定

7月12日	3ヶ月	第844回
7月18日	1年	第845回
7月19日	3ヶ月	
7月26日	3ヶ月	
7月17日	20年	
7月23日	40年	
7月25日	2年	
8月1日	10年	

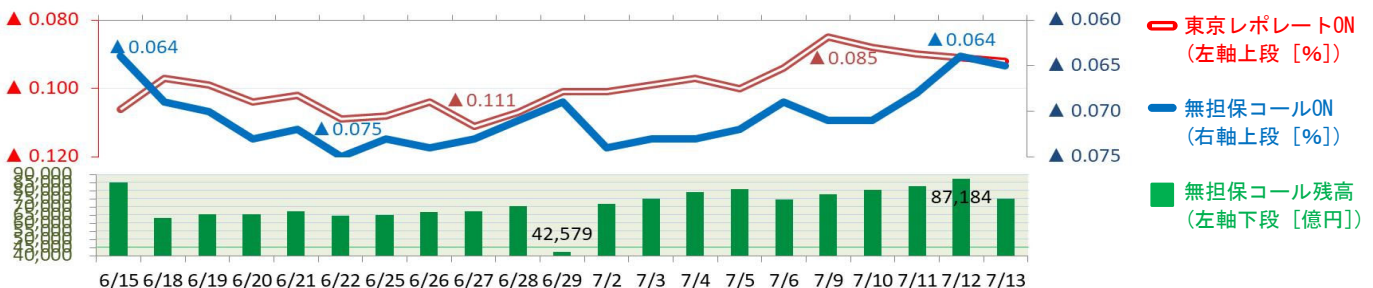
## 今月の国債買入オペ予定

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。