DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社
TEL:0120-327-017

2019年7月12日(金)

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月8日	7月9日	7月10日	7月11日
加重平均金利	▲0.075	▲0.076	▲0.077	▲0.076
東京レポレート(ON)	▲0.115	▲0.110	▲0.100	▲0.103
無コール残	80,280	78,903	79,201	77,704
ON	45,165	41,513	40,701	41,574
その他	35,115	37,390	38,500	36,130
有コール残	18,492	18,377	22,739	22,316

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16日の予定（時刻は日本時間）

日本		予想	海外		予想
8:50	金融政策決定会合議事録等（2009年1月～6月開催分）	－	21:30	(米)6月小売売上高	0.2%
17:00	業態別の日銀当座預金残高(6月)	－	22:15	(米)6月鉱工業生産指数[前月比]	0.2%
	－		22:15	(米)6月設備稼働率	78.1%

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	▲0.094
T/N	－	－	－	▲0.097
S/N	－	－	－	－
1W	▲0.060	▲0.055	▲0.058	▲0.098
2W	▲0.062	0.000	▲0.048	▲0.102
3W	－	－	－	▲0.106
1M	－	－	▲0.025	▲0.108
2M	－	－	－	－
3M	－	－	－	▲0.124
6M	－	－	－	▲0.149
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。
同加重平均金利（速報）は前営業日対比横ばいの▲0.076%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ～ ▲ 0.086	▲ 0.086 ～ ▲ 0.045	▲ 0.086 ～ ▲ 0.060

翌営業日のマーケット

積み初日となるが調達サイド動きにの大きな変化はなく、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12日		7月16日		7月17日	
券		▲100		+800		+1,000
財政		▲28,300		+5,200		+3,000
過不足		▲28,400		+6,000		+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
国庫短期証券買入		+5,000				
国債買入				+10,300		
共通担保(全店)			▲700	+700		
CP等買入	▲200	+2,000	▲700			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+100					
当座預金増減		▲21,600		+15,600		+4,000
当座預金残高		4,006,000		4,021,600		4,025,600
準備預金残高		3,492,600	主な需給要因			
積み終了先		3,492,600				
超過準備		3,492,500	国債償還(2年)			
非準預先残高		513,400	国庫短期証券			
準備預金進捗率		100.0%	発行・償還(3M)			
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

7月12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
国債買入(7/16～)						
1～3年	3,800	10,041	3,804	0.008	0.010	45.7
3～5年	3,800	10,231	3,813	0.010	0.011	61.5
10～25年	1,800	3,325	1,810	0.016	0.020	64.3
25年～	400	1,021	401	0.026	0.030	32.7
国債補完供給(7/12～7/16)						
	78,124	1	1	▲0.350	▲0.350	
共通担保(全店)(7/16～7/29)						
	15,000	655	655			

マネタリーベース [億円]

7月11日時点	5,151,100

所要

[億円]

来積期の所要準備額	3,193,500
7月16日以降の残り所要	
積数	3,193,500
平均	103,000

国庫短期証券入札予定

7月18日	1年	第845回
7月19日	3ヶ月	第846回
7月26日	3ヶ月	
8月2日	3ヶ月	

国債入札予定

7月17日	20年
7月23日	40年
7月25日	2年
8月1日	10年

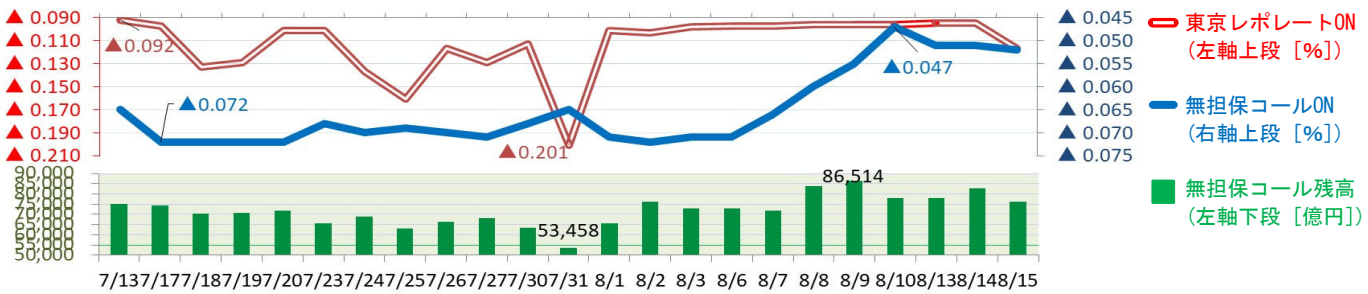
今月の国債買入オペ予定

[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						7月5日	1
1年超3年以下	2,500～5,000 程度	3,800	3	12	22	31			7月12日	2
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			7月5日	3
10年超25年以下	1,000～2,500 程度	1,800	3	12	26				7月12日	1
25年超	100～1,000 程度	400								
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7月積み期 [7月13日～8月15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