

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年7月16日(火)

短期市場の推移

[億円][%]

	7月9日	7月10日	7月11日	7月12日
加重平均金利	▲0.076	▲0.077	▲0.076	▲0.076
東京レポレート(ON)	▲0.110	▲0.100	▲0.103	▲0.094
無コール残	78,903	79,201	77,704	80,108
ON	41,513	40,701	41,574	44,193
その他	37,390	38,500	36,130	35,915
有コール残	18,377	22,739	22,316	21,977

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		G7財務相中銀総裁会議 (シャンティ、18日まで)	-
-		17:30 (英)6月消費者物価 コア指数[前年比]	-
-		(米)ページブック	

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	▲0.089
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	0.000	▲0.055	▲0.094
2W	▲0.060	▲0.015	▲0.039	▲0.097
3W	-	-	▲0.050	▲0.103
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
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、▲0.080%の合出から始まった。
その後は主に▲0.086~▲0.060%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+0.004%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.070	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.086 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

調達意欲がやや強まり、出合の水準は小幅上昇と予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 7月16日	日銀予想 7月17日	当社需給予想 7月18日
券	+800	+1,000	+0
財政	+6,700	+800	▲6,000
過不足	+7,500	+1,800	▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+10,300	+5,000	スタート
共通担保(全店)	▲700		
CP等買入	▲700	▲200	
ETF買入		+700	
国債補完供給	▲400	+400	
当座預金増減	+16,700	+7,700	▲6,000
当座預金残高	4,022,700	4,030,400	4,024,400
準備預金残高	3,500,700	主な需給要因	
積み終了先	2,162,900		
超過準備	939,500		
非準備預金残高	522,000	国債発行(20年)	
準備預金進捗率	80.2%		
平均	3.2%		
乖離率	77.0%		

7月16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(7/17~)					
5~10年	4,800	16,482	4,812	▲0.012	▲0.012 96.1

米ドル資金供給(7/18~7/25)	0	0	2,880	2,880
--------------------	---	---	-------	-------

国債補完供給(7/16~7/17)	168,511	366	366	▲0.350	▲0.350
-------------------	---------	-----	-----	--------	--------

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
7月12日時点 5,129,500	今積期の所要準備額 3,193,500
	7月17日以降の残り所要積数 632,400
	平均 21,100

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	
7月17日	20年	
7月23日	40年	
7月25日	2年	
8月1日	10年	

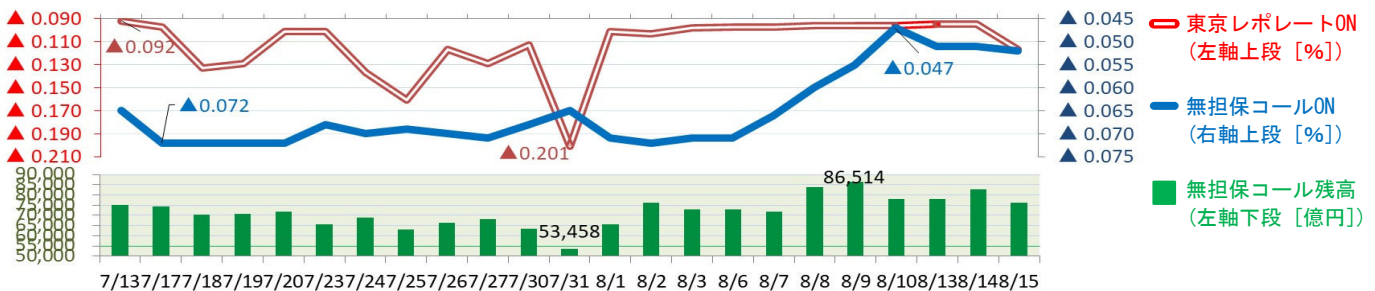
今月の国債買入オペ予定

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12日	2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 22 31	7月16日	2
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12日	1
物価運動債	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。