

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年7月18日(木)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	7月11日	7月12日	7月16日	7月17日
加重平均金利	▲0.076	▲0.076	▲0.072	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.094	▲0.089	▲0.098
無コール残	77,704	80,108	85,712	96,303
ON	41,574	44,193	55,102	63,433
その他	36,130	35,915	30,610	32,870
有コール残	22,316	21,977	21,400	20,533

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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	6月消費者物価コア指数[前年比]	+0.6%	23:00	(米)7月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	98.4
	-			(米)セントルイス連銀総裁の講演	
	-			(米)ボストン連銀総裁の講演	

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	▲0.080	0.001	▲0.065	▲0.093
T/N	-	-	▲0.070	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.035	▲0.039	▲0.100
2W	▲0.040	0.000	▲0.032	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	-	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.122
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、▲0.070%の合出から始まった。その後は主に▲0.070%~▲0.055%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+0.001%の▲0.065%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.055

## 翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に変化はなく、合出の水準は横ばいと予想する。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月18日	7月19日	7月19日	7月22日	7月22日	7月22日
券	▲300	+200		+0		+0
財政	▲13,200	+7,700		▲4,000		▲4,000
過不足	▲13,500	+7,900		▲4,000		▲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		+2,500				▲2,600
共通担保(全店)						
CP等買入	▲100		▲300			
社債等買入	▲100		▲100			
被災地金融機関支援			▲1,100	+1,100		
国債補完供給	+200					
当座預金増減	▲11,000	+7,500		▲6,600		
当座預金残高	4,017,200	4,024,700		4,018,100		
準備預金残高	3,491,900					
積み終了先	3,447,600					
超過準備	3,433,300					
非準預先残高	525,300					
準備預金進捗率	98.1%					
平均	9.7%					
乖離率	88.4%					

7月18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
国債補完供給(7/18~7/19)	88,022	33	33	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
7月17日時点 5,149,900

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,193,500  
7月19日以降の残り所要積数 61,500  
平均 2,200

## 国庫短期証券入札予定

7月19日	3ヶ月	第846回
7月26日	3ヶ月	
8月2日	3ヶ月	
8月8日	6ヶ月	
7月23日	40年	
7月25日	2年	
8月1日	10年	
8月6日	30年	

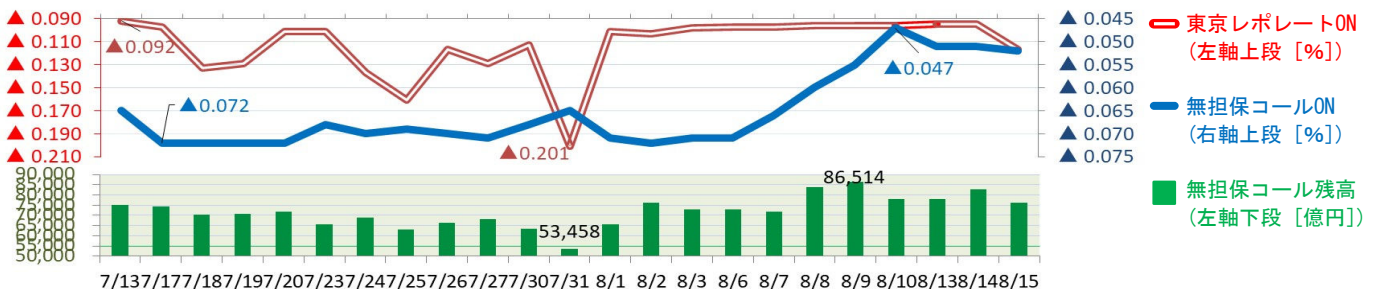
## 今月の国債買入オペ予定

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。