

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年7月22日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月16日	7月17日	7月18日	7月19日
加重平均金利	▲0.072	▲0.066	▲0.065	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.089	▲0.098	▲0.093	▲0.088
無コール残	85,712	96,303	91,332	93,898
ON	55,102	63,433	59,087	62,613
その他	30,610	32,870	32,245	31,285
有コール残	21,400	20,533	23,514	23,850

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23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
0:00 L講演/黒田総裁(IMF) Michel Camdessus Central Banking Lecture (7月22日)	-	23:00 (米)6月中古住宅販売 件数	535万件
10:00 営業毎旬報告 (7月20日現在)	-	(米)5月FHFA住宅価格 指数	
月例経済報告(内閣府)			

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	▲0.063	▲0.092
T/N	-	-	▲0.070	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.045	▲0.092
2W	▲0.040	▲0.025	▲0.033	▲0.095
3W	-	-	0.001	▲0.096
1M	-	-	-	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.121
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%~▲0.060%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+0.001%の▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.060

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22日	7月23日	7月23日	7月24日	7月24日	7月25日
券		+400	▲300	+0		
財政		+400	+1,700	▲2,000		
過不足		+800	+1,400	▲2,000		
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				+12,900		
共通担保(全店)	▲2,600	+2,400				
CP等買入	▲600		▲100			
社債等買入				+1,300		
ETF買入		+100		+600		
国債補完供給		▲400	+400			
当座預金増減		▲300	+16,500	▲2,000		
当座預金残高		4,024,400	4,040,900	4,038,900		
準備預金残高		3,512,300	主な需給要因			
積み終了先		3,511,300				
超過準備		3,510,700				
非準備先残高		512,100				
準備預金進捗率		99.5%				
平均		22.6%				
乖離率		77.0%				

7月22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(7/23~)						
1~3年	3,800	14,242	3,809	0.000	0.001	18.4
3~5年	3,800	11,346	3,802	0.000	0.001	68.6
5~10年	4,800	10,730	4,802	▲0.001	0.000	68.2
物価連動	250	1,089	250	▲0.010	▲0.054	53.3
国債補完供給(7/22~7/23)						
	312,862	358	358	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
7月19日時点 5,146,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,193,500
7月23日以降の残り所要積数 14,400
平均 600

国庫短期証券入札予定

7月26日	3ヶ月	第847回
8月2日	3ヶ月	
8月8日	6ヶ月	
8月9日	3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22日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 22 31	7月22日	1
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22日	0
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。