

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年7月23日(火)

短期市場の推移

	7月17日	7月18日	7月19日	7月22日
加重平均金利	▲0.066	▲0.065	▲0.064	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.093	▲0.088	▲0.092
無コール残	96,303	91,332	93,898	92,505
ON	63,433	59,087	62,613	53,800
その他	32,870	32,245	31,285	38,705
有コール残	20,533	23,514	23,850	20,352

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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
5月景気動向指数改訂値 (内閣府)		20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
-		23:00	(米)6月新築住宅販売件数
-			67.0万戸

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	▲0.088
T/N	-	-	▲0.070	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.091
2W	▲0.040	0.000	▲0.027	▲0.092
3W	▲0.050	0.001	▲0.038	▲0.093
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	▲0.040	0.060	0.010	▲0.119
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▲0.075%~▲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▲0.002%の▲0.065%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.075 ~ ▲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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月23日	7月24日	7月23日	7月24日	7月23日	7月24日
券	▲300	+0	▲300	+0	▲1,000	+0
財政	+0	▲5,700	+0	▲5,700	+7,000	+7,000
過不足	▲300	▲5,700	▲300	▲5,700	+6,000	+6,000
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		+12,900				
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入		+1,300				
ETF買入		+600		+300		
国債補完供給	+400	▲100	+100			
当座預金増減	+14,700	▲400	+14,700	▲400	+6,000	+6,000
当座預金残高	4,039,100	4,038,700	4,039,100	4,038,700	4,044,700	4,044,700
準備預金残高	3,514,900		3,514,900			
積み終了先	3,513,900		3,513,900			
超過準備	3,513,900		3,513,900			
非準備先残高	524,200		524,200			
準備預金進捗率	99.6%		99.6%			
平均	25.8%		25.8%			
乖離率	73.8%		73.8%			

7月23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(7/24~)	5,000	17,686	5,002	0.007	0.009	28.4
米ドル資金供給(7/25~8/1)	0	0	2,880	2,880		
国債補完供給(7/23~7/24)	125,789	38	38	▲0.350	▲0.350	
	5,559	49	49	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
7月22日時点 5,145,700	今積期の所要準備額 3,193,500
	7月24日以降の残り所要積数 13,300
	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25日	2年	
8月1日	10年	
8月6日	30年	
8月8日	物価連動	

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。