

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年6月21日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月15日	6月18日	6月19日	6月20日
加重平均金利	▲0.084	▲0.069	▲0.070	▲0.073
東京レポレート(ON)	▲0.106	▲0.097	▲0.099	▲0.104
無コール残	85,086	63,464	65,695	65,647
ON	52,746	34,964	37,265	36,057
その他	32,340	28,500	28,430	29,590
有コール残	24,450	23,014	20,816	27,085

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。

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	▲0.102
T/N	-	-	0.000	▲0.122
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.080	▲0.040	▲0.060	▲0.132
2W	-	-	-	▲0.164
3W	-	-	-	▲0.152
1M	-	-	-	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.150
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

6月22日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	5月消費者物価 コア指数[前年比]	+0.7%	17:00	(欧)6月製造業購買 担当者指数(PMI)	55.0
10:00	営業毎旬報告 (6月20日現在)	-	22:45	(米)6月製造業PMI	56.3
-	【記者会見】布野審議 委員(6月21日)	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

無担保コールON物は、昨日よりもさらにビッドが薄く、▲0.086%~▲0.050%の水準で取引される軟調な地合となった。
同加重平均金利(速報)は、▲0.08%台のビッドが減ったことで、前日比+0.001%の▲0.072%となった。

O/N業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.050

明日のマーケット

週末3日積となるが、本日同様に軟調な地合が継続する見込み。
▲0.086%~▲0.050%の水準で取引されると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月21日	6月22日	6月25日
券	▲1,800	▲1,400	+0
財政	▲4,300	▲17,900	▲1,000
過不足	▲6,100	▲19,300	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,300		
共通担保(全店)			▲1,500
CP等買入	▲100	▲400	
社債等買入			+1,800
ETF買入	+100		
国債補完供給	+600	+500	
当座預金増減	+1,300	▲19,200	▲700
当座預金残高	3,932,800	3,913,600	3,912,900
準備預金残高	3,452,000	主な需給要因	
積み終了先	3,447,000		
超過準備	3,446,900		
非準備先残高	480,800		
準備預金進捗率	99.5%	国債発行(5年)	国庫短期証券 発行・償還(3M)
平均	20.0%		
乖離率	79.5%		

6月21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
国債補完供給(6/21~6/22)						
	86,542	196	196	▲0.600	▲0.600	
	22,324	300	300	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース[億円]
6月20日時点 5,016,300

所要
今積期の所要準備額 3,017,200
6月22日以降の残リ所要
積数 14,600
平均 600

国庫短期証券入札予定

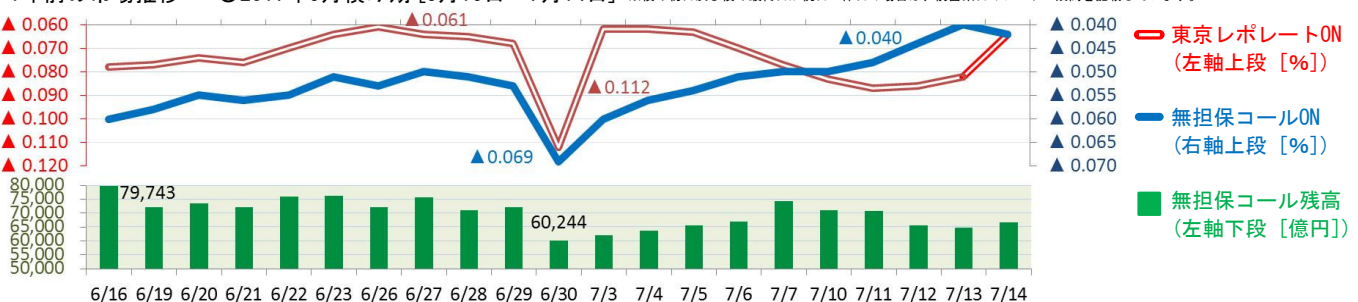
6月22日	3ヶ月	第766回
6月29日	3ヶ月	
7月6日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
国債入札予定		
6月26日	20年	
6月28日	2年	
7月3日	10年	
7月5日	30年	

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		
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500	4	6	14
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	22	27	29
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	1	6	13
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900	20	22	29
25年超	500~1,500 程度	700	4	8	14
物価連動債	250 程度	250	月2回程度		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	6月13日	0
				6月8日	0

1年前の市場推移

○2017年6月積み期 [6月16日~7月14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