

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年6月22日(金)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月18日	6月19日	6月20日	6月21日
加重平均金利	▲0.069	▲0.070	▲0.073	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.099	▲0.104	▲0.102
無コール残	63,464	65,695	65,647	67,546
ON	34,964	37,265	36,057	36,016
その他	28,500	28,430	29,590	31,530
有コール残	23,014	20,816	27,085	20,163

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	▲0.075	▲0.109
T/N	-	-	0.000	▲0.120
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.080	0.000	▲0.043	▲0.180
2W	-	-	-	▲0.157
3W	▲0.065	0.050	▲0.050	▲0.148
1M	-	-	-	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
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25日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	金融政策決定会合における主な意見(6月14・15日分)	-	(米)5月のシカゴ連銀全米活動指数	-	-
14:00	4月の景気動向指数改定値(内閣府)	-	(独)6月のIFO景況感指数	-	101.8
	国債市場特別参加者会合(財務省)	-			

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、▲0.085%の出合から始まった。引き続き調達ニーズは弱く、主な出合の水準は▲0.086%~▲0.050%であった。同加重平均金利は▲0.075%と、5月2日以来約1か月半ぶりの低水準となった。

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

明日のマーケット

週明け25日も、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22日	6月25日	6月26日
券	▲1,500	▲100	▲1,000
財政	▲17,400	+6,000	+2,000
過不足	▲18,900	+5,900	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+9,900	
共通担保(全店)		▲1,500	+1,300
CP等買入	▲400	▲500	
社債等買入		▲200	+1,800
国債補完供給	+500	▲900	+900
当座預金増減	▲19,700	+17,600	+1,000
当座預金残高	3,913,100	3,930,700	3,931,700
準備預金残高	3,434,500	主な需給要因	
積み終了先	3,433,800		
超過準備	3,431,100	国庫短期証券 発行・償還 (3M)	
非準備預金残高	478,600		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	30.0%		
乖離率	69.9%		

6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	按分
国債買入(6/25~)						
1~3年	2,500	12,968	2,505	0.005	0.005	73.8
3~5年	3,000	10,248	3,009	0.001	0.001	80.7
5~10年	4,300	14,135	4,311	▲0.001	0.000	61.4
国債補完供給(6/22~6/25)						
	50,726	566	566	▲0.600	▲0.600	
	2,319	322	322	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(6/25~7/9)						
	8,000	1,260	1,260			

マネタリーベース [億円]
6月21日時点 5,019,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,017,200
6月25日以降の残り所要
積数 4,500
平均 200

国庫短期証券入札予定

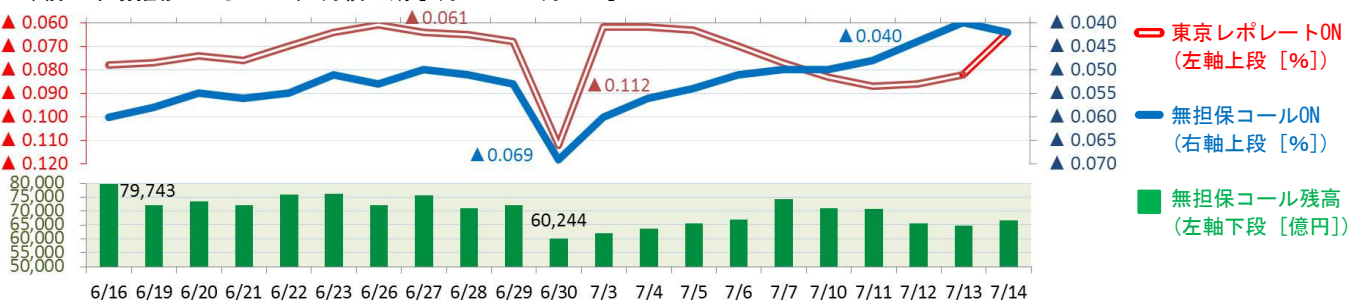
6月29日	3ヶ月	第76/回
7月6日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月13日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月26日	20年	
6月28日	2年	
7月3日	10年	
7月5日	30年	

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