

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年6月26日(火)

## 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	6月20日	6月21日	6月22日	6月25日
加重平均金利	▲0.073	▲0.072	▲0.075	▲0.073
東京レポレート(ON)	▲0.104	▲0.102	▲0.109	▲0.108
無コール残	65,647	67,546	64,836	65,099
ON	36,057	36,016	33,526	33,979
その他	29,590	31,530	31,310	31,120
有コール残	27,085	20,163	17,808	18,214

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。

## 6月27日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	資金循環統計(速報) (1~3月期)	-	20:00	(米)MBA住宅ローン 申請指数[前週比]	-
-	-	-	21:30	(米)5月の 耐久財受注	▲0.2%
-	-	-	-	(米)5月の財の 貿易収支	-

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	▲0.086	0.001	▲0.074	▲0.104
T/N	-	-	0.000	▲0.115
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.156
2W	-	-	-	▲0.146
3W	-	-	-	▲0.142
1M	-	-	-	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
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

## 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。  
昨日に引き続きビッドが薄く、主な出合の水準は▲0.086%~▲0.050%であった。  
同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.074%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

## 翌営業日のマーケット

引き続き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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月26日	6月27日	6月27日	6月28日	6月28日	6月29日
券	▲1,200	▲800	▲800	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲900	▲11,300	▲11,300	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	▲2,100	▲12,100	▲12,100	+2,000	+2,000	+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
国庫短期証券買入		+7,500				
CP等買入	▲200		▲300			
ETF買入				+100		
国債補完供給	+400	▲300	+300			
当座預金増減	+5,300	▲12,000	▲12,000	+2,000	+2,000	+2,000
当座預金残高	3,933,300	3,921,300	3,921,300	3,923,300	3,923,300	3,923,300
準備預金残高	3,443,800					
積み終了先	3,443,500					
超過準備	3,443,500					
非準備先残高	489,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	36.7%					
乖離率	63.2%					

## 6月26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
米ドル資金供給(6/28~7/6)		1	1	2,430	2,430	
CP等買入(6/29~)	2,500	5,740	2,465	▲0.005	▲0.002	28.7
国債補完供給(6/26~6/27)	68,333	298	298	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]  
6月25日時点 5,016,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,017,200  
6月27日以降の残り所要積数 3,800  
平均 200

## 国庫短期証券入札予定

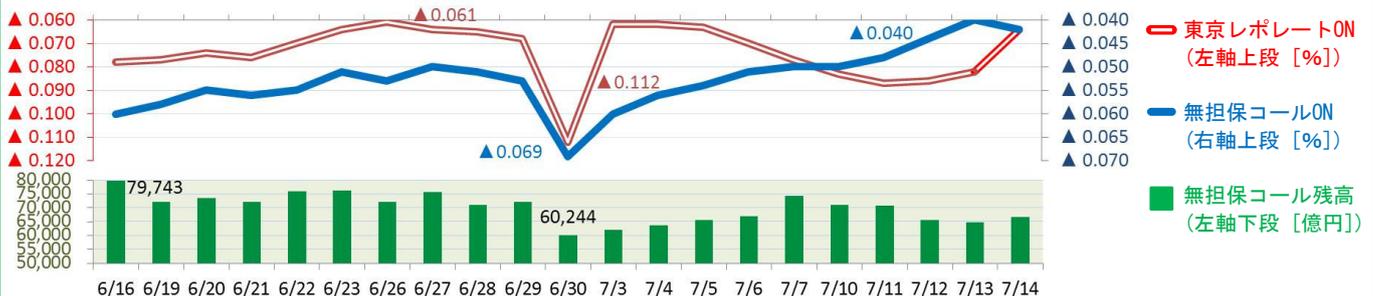
6月29日	3ヶ月	第76/回
7月6日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月13日	3ヶ月	
6月28日	2年	
7月3日	10年	
7月5日	30年	
7月10日	5年	

## 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			
25年超	500~1,500 程度	700	4 8 14 20 27	6月20日	1
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。