

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年7月3日(火)

短期市場の推移

	6月27日	6月28日	6月29日	7月2日
加重平均金利	▲0.073	▲0.071	▲0.069	▲0.074
東京レポレート(ON)	▲0.111	▲0.107	▲0.101	▲0.101
無コール残	67,501	70,588	42,579	71,968
ON	36,681	41,518	27,059	45,543
その他	30,820	29,070	15,520	26,425
有コール残	17,952	17,959	22,141	19,046

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4日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (7月見込み)	-	(米)休場 (独立記念日)	-
10:30	【挨拶】原田審議委員 (石川)	-	(英)6月サービス業 購買担当者指数(PMI)	53.9
14:00	需給ギャップと 潜在成長率	-	(米)MBA住宅ローン申請 指数[前週比]	-

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	▲0.073	▲0.099
T/N	-	-	0.000	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.020	▲0.061	▲0.107
2W	▲0.070	0.001	▲0.037	▲0.110
3W	0.000	0.035	0.004	▲0.114
1M	-	-	▲0.025	▲0.121
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.148
1Y	-	-	-	▲0.158

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▲0.086%の出合から始まった。一部ではレートを上げて調達をする先が見られたものの、引続き▲0.080%を中心に推移した。同加重平均金利は前営業日対比+0.001%の▲0.073%となった。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

大幅不足日であることから、調達意欲がやや強まると予想されるため、ON物加重平均金利は上昇方向と見料する。

資金需給

	日銀速報 7月3日	日銀予想 7月4日	当社需給予想 7月5日
券	▲200	+300	+0
財政	▲6,000	▲48,700	▲2,000
過不足	▲6,200	▲48,400	▲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
国庫短期証券買入		+5,000	
国債買入		+3,400	
ETF買入			+100
国債補完供給	+1,400	▲200	+200
当座預金増減	+3,400	▲48,100	▲2,000
当座預金残高	3,922,300	3,874,200	3,872,200
準備預金残高	3,422,100	主な需給要因	
積み終了先	3,422,000	法人税	
超過準備	3,422,000	消費税	
非準備先残高	500,200	保険揚げ	
準備預金進捗率	99.9%	国債発行	(10年)
平均	60.0%		
乖離率	39.9%		

7月3日のオペ結果 [%(億ドル)] ※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(7/6~7/12)		1	1	2,420	2,420	
国債補完供給(7/3~7/4)	13,027	179	179	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
7月2日時点 5,011,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,018,100
7月4日以降の残り所要
積数 2,000
平均 200

国庫短期証券入札予定

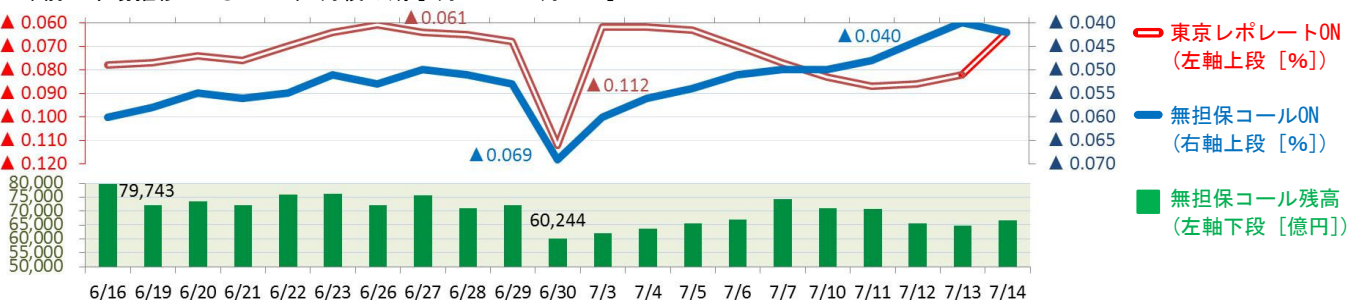
7月6日	3ヶ月	第768回
7月9日	6ヶ月	第769回
7月13日	3ヶ月	
7月19日	1年	
国債入札予定		
7月5日	30年	
7月10日	5年	
7月12日	20年	
7月24日	40年	

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2日	1
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 11 17 23 27	6月29日	6
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 11 13 19 25 27	6月29日	6
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900			
25年超	500~1,500 程度	700	2 6 13 19 25	7月2日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	7月2日	1
変動利付償く偶数月	1,000 程度	1,000	-	6月8日	-

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。