

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年7月4日(水)

## 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	6月28日	6月29日	7月2日	7月3日
加重平均金利	▲0.071	▲0.069	▲0.074	▲0.073
東京レポレート(ON)	▲0.107	▲0.101	▲0.101	▲0.099
無コール残	70,588	42,579	71,968	75,261
ON	41,518	27,059	45,543	47,381
その他	29,070	15,520	26,425	27,880
有コール残	17,959	22,141	19,046	24,442

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30 【挨拶】政井審議委員 (長野)	-	21:15 (米)6月ADP 全米雇用報告	19.0万人
- 【記者会見】原田 審議委員(7月4日)	-	21:30 (米)新規失業保険 申請件数[前週分]	-
-	-	23:00 (米)6月ISM非製造業 景況指数	58.0

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	▲0.097
T/N	-	-	0.000	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.032	▲0.106
2W	-	-	0.020	▲0.108
3W	-	-	0.000	▲0.113
1M	-	-	-	▲0.119
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▲0.080%の出合から始まった。一部では▲0.05%台の出合も見られたが、昨日同様、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横ばいの▲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 ~ ▲0.085	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.050

## 翌営業日のマーケット

税揚げ後となることから、調達意欲がやや強まると予想されるため、出合レンジは小幅に上昇すると料する。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月4日	7月5日	7月5日	7月6日	7月6日	7月6日
券		+400	▲500		+0	
財政		▲51,400	▲100		+0	
過不足		▲51,000	▲600		+0	
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
国債買入				+9,900		
CP等買入			▲300			
ETF買入		+100				
国債補完供給	+200	▲200	+200			
当座預金増減		▲50,900	+9,200		+0	
当座預金残高		3,871,400	3,880,600		3,880,600	
準備預金残高		3,378,600				
積み終了先		3,378,400				
超過準備		3,378,400				
非準預先残高		492,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		63.3%				
乖離率		36.6%				

## 7月4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
国債買入(7/5~)						
1~3年	2,500	13,215	2,505	0.004	0.004	91.5
3~5年	3,000	9,564	3,005	0.001	0.001	72.8
5~10年	4,100	14,599	4,115	▲0.003	▲0.002	29.1
国債補完供給(7/4~7/5)						
	18,445	234	234	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]  
7月3日時点 5,015,100

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,018,100  
7月5日以降の残り所要積数 1,800  
平均 200

## 国庫短期証券入札予定

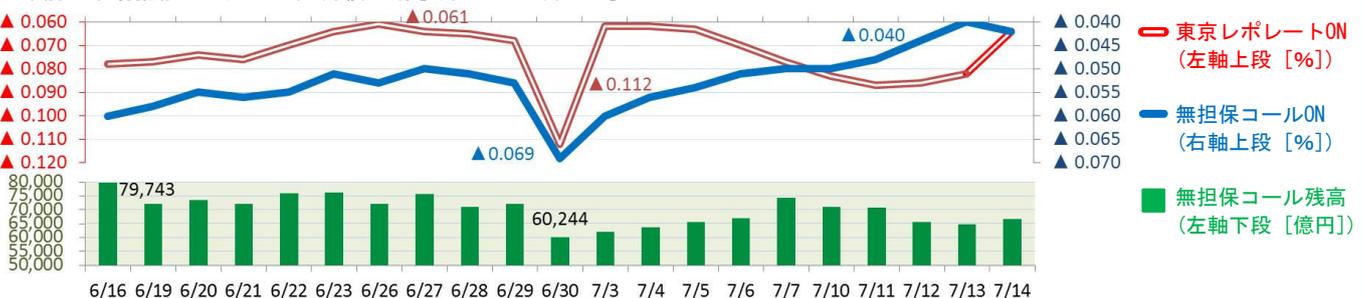
7月6日	3ヶ月	第768回
7月9日	6ヶ月	第769回
7月13日	3ヶ月	
7月19日	1年	
国債入札予定		
7月5日	30年	
7月10日	5年	
7月12日	20年	
7月24日	40年	

## 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	7月4日 5
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4	11 13 19 25 27	7月4日 5
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
変動利付債<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。