

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年7月5日(木)

## 短期市場の推移

	6月29日	7月2日	7月3日	7月4日
加重平均金利	▲0.069	▲0.074	▲0.073	▲0.073
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.101	▲0.099	▲0.097
無コール残	42,579	71,968	75,261	79,370
ON	27,059	45,543	47,381	50,330
その他	15,520	26,425	27,880	29,040
有コール残	22,141	19,046	24,442	27,722

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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 マネタリーベースと日本銀行の取引(6月)	-	21:30 (米)6月失業率	3.8%
15:00 コール市場残高(6月)	-	21:30 (米)6月非農業部門雇用者数	19.8万人
- 【記者会見】政井審議委員(7月5日)	-	21:30 (米)5月貿易収支	-454億米ドル

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	▲0.072	▲0.100
T/N	-	-	0.000	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.040	▲0.048	▲0.104
2W	-	-	▲0.055	▲0.107
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。その後は▲0.085~▲0.05%で取引された。同加重平均金利は前営業日対比+0.001%の▲0.072%となった。ショートタームは地銀業態で▲0.055%近辺の出合が見られた。

## 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

引続き調達意欲はやや強まると予想されるため、出合レンジも小幅上昇方向と料する。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月5日	7月6日	7月9日
券	▲400	▲300	+1,000
財政	▲1,800	▲6,300	▲2,000
過不足	▲2,200	▲6,600	▲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)			▲1,400
CP等買入	▲300	▲100	
ETF買入		+1,100	
国債補完供給	+200	▲1,000	+1,000
当座預金増減	+6,600	▲4,600	▲2,400
当座預金残高	3,878,000	3,873,400	3,871,000
準備預金残高	3,382,700	主な需給要因	
積み終了先	3,382,500		
超過準備	3,382,500		
非準備先残高	495,300	国債発行(30年)	国庫短期証券発行・償還(3M)
準備預金進捗率	99.9%		
平均	66.7%		
乖離率	33.2%		

## 7月5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
CP等買入(7/10~)	2,000	6,111	1,981	▲0.003	0.000	37.4
国債補完供給(7/5~7/6)	57,197	973	973	▲0.600	▲0.600	
	20,231	17	17	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]  
7月4日時点 4,963,800

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,018,100  
7月6日以降の残リ所要積数 1,700  
平均 200

## 国庫短期証券入札予定

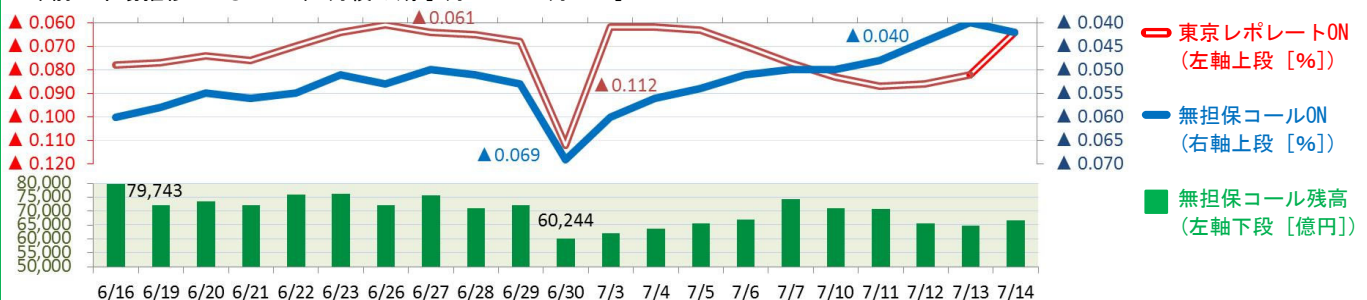
7月6日	3ヶ月	第768回
7月9日	6ヶ月	第769回
7月13日	3ヶ月	
7月19日	1年	
7月10日	5年	
7月12日	20年	
7月24日	40年	
7月26日	2年	

## 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
変動利付償<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。