

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年7月6日(金)

短期市場の推移

	7月2日	7月3日	7月4日	7月5日
加重平均金利	▲0.074	▲0.073	▲0.073	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.099	▲0.097	▲0.100
無コール残	71,968	75,261	79,370	80,846
ON	45,543	47,381	50,330	50,731
その他	26,425	27,880	29,040	30,115
有コール残	19,046	24,442	27,722	24,201

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9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	貸出・預金動向(6月)	-	15:00	(独)5月貿易収支 195億ユーロ
9:30頃	【挨拶】黒田総裁(支店長会議)	-	15:00	(独)5月経常収支 -
14:00	地域経済報告(7月)	-		

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	▲0.069	▲0.094
T/N	-	-	0.000	▲0.097
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.058	▲0.040	▲0.053	▲0.101
2W	▲0.055	0.000	▲0.035	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.112
1M	-	-	0.050	▲0.118
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▲0.075%の出合から始まった。その後は▲0.086~▲0.05%で取引された。同加重平均金利は前営業日対比+0.003%の▲0.069%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	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

週明けも地銀業態を中心に積極的な調達が見られると予想するため、▲0.05%台の出合は増加方向か。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月6日	7月9日	7月9日	7月10日	7月10日	7月10日
券	▲100	+1,200	+1,200	+0	+0	+0
財政	▲7,100	+1,500	+1,500	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	▲7,200	+2,700	+2,700	▲1,000	▲1,000	▲1,000
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
国債買入				+8,600		
共通担保(全店)			▲1,400	+1,300		
CP等買入	▲100		▲200			+2,000
ETF買入		+1,100				
国債補完供給	+1,000	▲1,200	+1,200			
当座預金増減	▲6,400	+12,200	+12,200	+1,000	+1,000	+1,000
当座預金残高	3,871,600	3,883,800	3,883,800	3,884,800	3,884,800	3,884,800
準備預金残高	3,387,000					
積み終了先	3,386,800					
超過準備	3,386,800					
非準備先残高	484,600					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	76.7%					
乖離率	23.2%					

7月6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(7/9~)						
1~3年	2,500	10,969	2,505	0.004	0.005	35.4
3~5年	3,000	14,397	3,004	0.003	0.003	93.5
10~25年	1,900	6,360	1,910	▲0.003	▲0.003	99.9
25年~	700	2,447	702	▲0.009	▲0.008	90.7
国債補完供給(7/6~7/9)						
46,567	782	782	▲0.600	▲0.600		
20,654	318	318	▲0.600	▲0.600		
共通担保(全店)(7/9~7/23)	8,000	1,311	1,311			

マナタリーベース [億円]
7月5日時点 4,970,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,031,300
7月9日以降の残り所要積数 1,000
平均 100

国庫短期証券入札予定

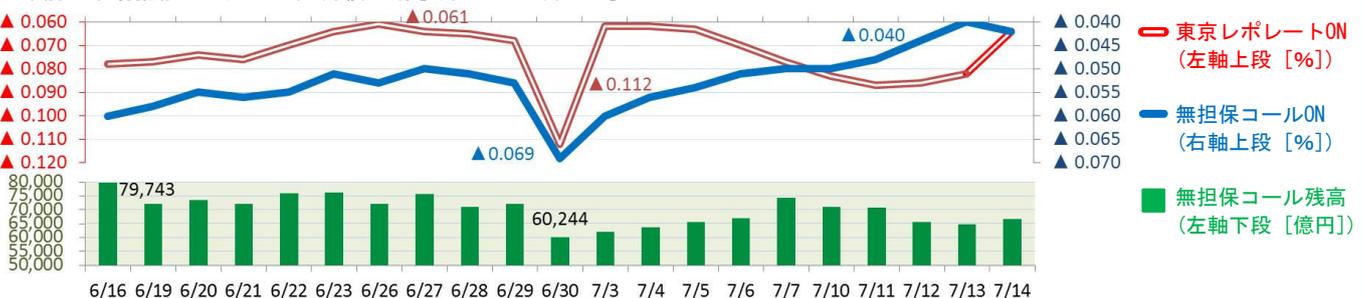
7月9日	6ヶ月	第769回
7月13日	3ヶ月	第770回
7月19日	1年	
7月20日	3ヶ月	
7月10日	5年	
7月12日	20年	
7月24日	40年	
7月26日	2年	

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6日	4
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6日	3
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。