

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年7月20日(金)

短期市場の推移

[億円][%]

	7月13日	7月17日	7月18日	7月19日
加重平均金利	▲0.065	▲0.072	▲0.072	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.092	▲0.097	▲0.133	▲0.129
無コール残	74,977	74,508	70,220	70,788
ON	45,252	48,513	44,875	44,383
その他	29,725	25,995	25,345	26,405
有コール残	28,301	24,973	21,431	21,898

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23日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		21:30	(米)6月シカゴ連銀 全米活動指数
		23:00	(米)6月中古住宅 販売件数
			546万件

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	▲0.101
T/N	-	-	0.000	▲0.121
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	0.001	▲0.047	▲0.126
2W	-	-	▲0.040	▲0.131
3W	-	-	-	▲0.133
1M	-	-	-	▲0.136
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.149
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▲0.08%の都合から始まり、その後は主に▲0.086~▲0.05%の水準で取引された。週末3日積みではあったものの、ビッドサイドの慎重な調達姿勢は変わらず、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.072%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	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

引き続き、ビッドサイドは慎重な調達姿勢のため、軟調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月20日	7月23日	7月23日	7月24日	7月24日	7月24日
券		+0	+500	+0	+0	
財政	▲13,600		+1,900	+3,000	+3,000	
過不足	▲13,600		+2,400	+3,000	+3,000	
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		+6,800				
共通担保(全店)			▲1,300	+1,300		
CP等買入	▲300		▲300			
社債等買入	▲100		▲100			
ETF買入		+100		+100		
被災地金融機関支援	▲1,100	+1,100				
国債補充供給	+400	▲300	+300			
当座預金増減	▲7,000		+2,400	+3,000		
当座預金残高	3,878,500		3,880,900	3,883,900		
準備預金残高	3,391,500					
積み終了先	3,389,200					
超過準備	3,383,600					
非準備預金残高	487,000					
準備預金進捗率	99.5%					
平均	22.6%					
乖離率	76.9%					

7月20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
国債補充供給(7/20~7/23)	19,948	322	322	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(7/23~8/6)	8,000	1,263	1,263			

マナタリーベース [億円]
7月19日時点 4,977,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,129,300
7月23日以降の残り所要積数 14,700
平均 600

国庫短期証券入札予定

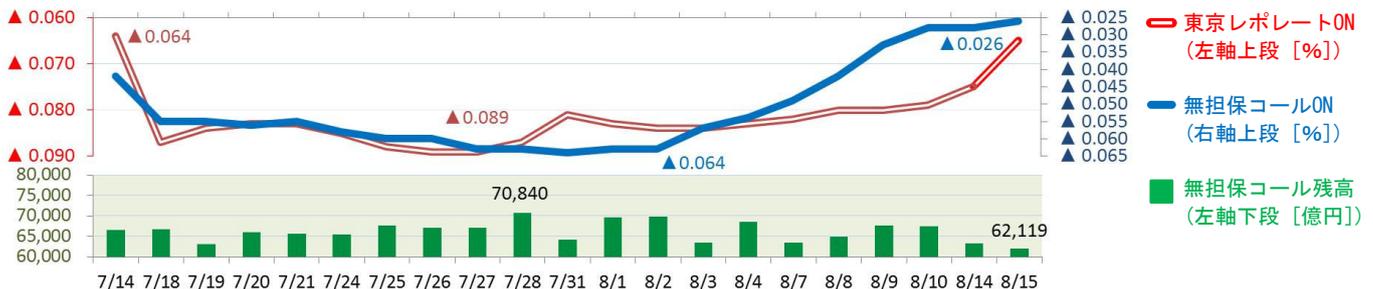
7月27日	3ヶ月	第7/3回
8月3日	3ヶ月	
8月9日	6ヶ月	
8月10日	3ヶ月	
7月24日	40年	
7月26日	2年	
8月2日	10年	
8月7日	物価連動	

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17日	2
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 11 13 19 25 27	7月19日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600	2 6 13 19 25	7月19日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	7月17日	0
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7月積み期 [7月14日~8月15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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会