DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社
TEL:0120-327-017

2020年6月30日(火)

短期市場の推移 [億円][%]

	6月24日	6月25日	6月26日	6月29日
加重平均金利	▲0.043	▲0.042	▲0.038	▲0.041
東京レポレート(ON)	▲0.061	▲0.063	▲0.058	▲0.060
無コール残	111,690	108,096	111,168	105,131
ON	65,101	61,827	66,389	61,812
その他	46,589	46,269	44,779	43,319
有コール残	19,890	20,225	20,695	21,043

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1日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	4-6月期日銀短観(大企業製造業DI)	-31	21:15	(米)6月ADP全米雇用報告	300万人
	-		23:00	(米)6月ISM製造業景況指数	49.0
	-			-	

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) 最低	最高	平均	レポ市場 東京レポレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.068	▲0.062
T/N	-	-	-	▲0.073
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.040	▲0.059	▲0.071
2W	▲0.005	0.010	▲0.002	▲0.073
3W	-	-	-	▲0.079
1M	▲0.060	▲0.001	▲0.037	▲0.087
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.163
1Y	-	-	-	▲0.188

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

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出合から始まり、
その後は主に▲0.080%～▲0.065%の水準で出合が見られた。
同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.027%の▲0.068%となった。

[%]

都銀･信託	証券	地銀
▲ 0.080 ～ ▲ 0.070	▲ 0.085 ～ ▲ 0.070	▲ 0.073 ～ ▲ 0.065

翌営業日のマーケット

月末に調達を控えていた先が戻ってくることで、出合水準は上昇すると予想。

資金需給 [億円]

	日銀速報 6月30日		日銀予想 7月1日		当社需給予想 7月2日	
券		▲900		▲700		+0
財政		+17,200		▲27,800		▲33,000
過不足		+16,300		▲28,500		▲33,000
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				+30,000		
国債買入		+6,400				
CP等買入	▲5,800	+6,000	▲100			
ETF買入		+1,100		+100		
国債補完供給	+100	▲2,400	+2,400			
米ドル資金供給用担保国債供給				▲4,000		
当座預金増減		+21,700		▲100		▲33,000
当座預金残高		4,470,200		4,470,100		4,437,100
準備預金残高		3,868,000	主な需給要因			
積み終了先		3,867,900				
超過準備		3,866,700				
非準預先残高		602,200	国債発行･償還(2年)		法人税･消費税･保険揚げ	
準備預金進捗率		99.9%				
平均		50.0%				
乖離率		49.9%				

6月30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	按分
国庫短期証券買入(7/1～)	30,000	76,867	30,003	0.006	0.006	82.3
米ドル資金供給(7/2～7/9)	21,182	21,182	0.320	0.320		
米ドル資金供給(7/2～9/25)	6,372	6,372	0.310	0.310		
国債補完供給(6/30～7/1)	2,420	2,420	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(7/1～7/10)	5,000	2,385	2,385	▲0.100	▲0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(7/1～9/28)	5,000	1,559	1,559	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース [億円]
6月29日時点 5,629,800

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,320,800
7月1日以降の残り所要	
積数	1,100
平均	100

国庫短期証券入札予定

7月3日	3ヶ月	第919回
7月9日	6ヶ月	
7月10日	3ヶ月	
7月16日	1年	

国債入札予定

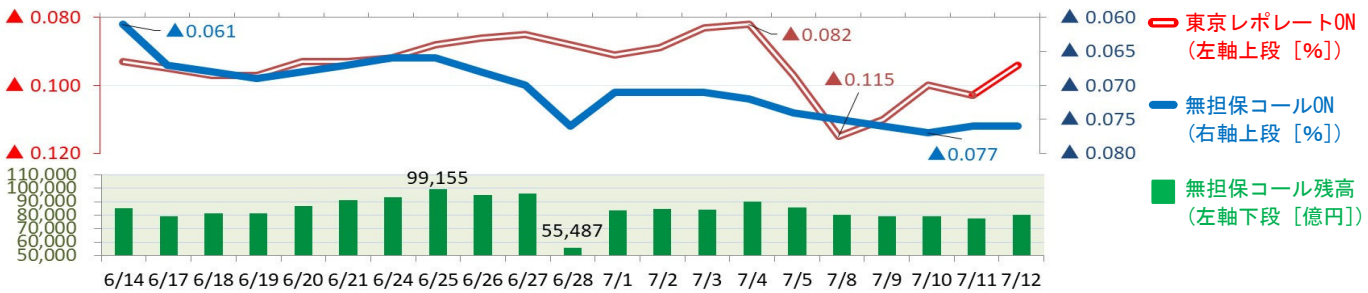
7月2日	10年
7月7日	30年
7月9日	5年
7月21日	20年

来月の国債買入オペ予定 [億円]

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	500～1,500	800	月3回程度						6月29日	3
1年超3年以下	2,500～6,000	3,400	3	8	10	17	22	29	6月26日	6
3年超5年以下	2,000～5,000	3,200	1	3	8	17	22	29	6月26日	6
5年超10年以下	2,500～6,000	4,000	6	10	17	22	31		6月29日	5
10年超25年以下	500～2,000	1,200	3	27					6月29日	2
25年超	0～500	300	10	31					6月17日	2
物価連動債	300	300	月2回程度						6月12日	2
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	-						6月3日	0

1年前の市場推移 ○2019年6月積み期 [6月14日～7月12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(登金)第 243号 加入協会 日本証券業協会