

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年7月1日(水)

## 短期市場の推移

	6月25日	6月26日	6月29日	6月30日
加重平均金利	▲0.042	▲0.038	▲0.041	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.063	▲0.058	▲0.060	▲0.062
無コール残	108,096	111,168	105,131	85,803
ON	61,827	66,389	61,812	64,720
その他	46,269	44,779	43,319	21,083
有コール残	20,225	20,695	21,043	17,950

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2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マナターベース(6月)	-	21:30	(米)6月非農業部門雇用者数 300.0万人
10:00	営業毎旬報告(6月30日現在)	-	21:30	(米)6月失業率 12.3%

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	▲0.080	0.001	▲0.041	▲0.071
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	0.000	▲0.031	▲0.079
2W	▲0.055	0.000	▲0.037	▲0.081
3W	-	-	▲0.010	▲0.083
1M	▲0.060	▲0.001	▲0.035	▲0.090
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.161
1Y	-	-	-	▲0.189

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▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.04%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▲0.041%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.070 ~ ▲0.040

## 翌営業日のマーケット

引き続き大手行の出合が中心となり、出合水準は横ばい圏の見込み。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月1日	7月2日	7月3日
券	▲600	▲1,300	▲1,000
財政	▲28,000	▲31,100	▲25,000
過不足	▲28,600	▲32,400	▲26,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+30,000		
国債買入		+4,600	
CP等買入	▲100	▲200	
ETF買入	+100	+900	
国債補完供給	+2,400		+35,500
米ドル資金供給用担保国債供給	▲4,000		
当座預金増減	▲200	▲27,100	+9,500
当座預金残高	4,470,000	4,442,900	4,452,400
準備預金残高	3,850,500	主な需給要因	
積み終了先	3,850,400	法人税・消費税・保険揚げ	
超過準備	3,850,300	国債発行(10年)	
非準備預金残高	619,500		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	53.3%		
乖離率	46.6%		

## 7月1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(7/2~)						
~1年	1,000	3,496	1,002	0.005	0.009	12.0
3~5年	3,500	9,001	3,507	0.006	0.007	56.2
国債補完供給(7/1~7/2)						
1		1	▲0.350	▲0.350		
0		0				

マナターベース [億円]  
6月30日時点 5,652,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,320,800  
7月2日以降の残り所要積数 900  
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	

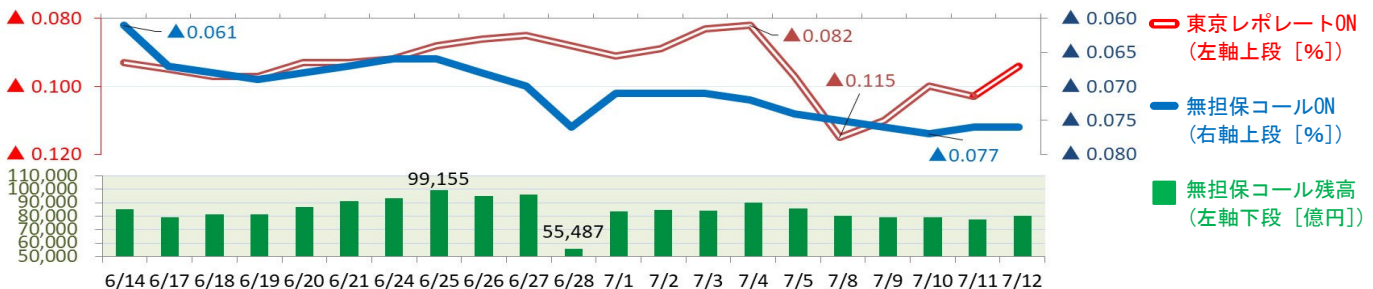
## 今月の国債買入オペ予定

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	500~1,500	1,000	月3回程度	7月1日	2
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	3,500	1 3 8 17 22 29	7月1日	5
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	-

## 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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会