

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年7月2日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月26日	6月29日	6月30日	7月1日
加重平均金利	▲0.038	▲0.041	▲0.068	▲0.041
東京レポレート(ON)	▲0.058	▲0.060	▲0.062	▲0.071
無コール残	111,168	105,131	85,803	94,145
ON	66,389	61,812	64,720	64,117
その他	44,779	43,319	21,083	30,028
有コール残	20,695	21,043	17,950	17,654

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3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因(7月見込み)	-	(米)休場(独立記念日の振替休日)	-
14:00	需給ギャップと潜在成長率	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.039	▲0.090
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.001	▲0.015	▲0.082
2W	▲0.065	▲0.050	▲0.054	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.085
1M	-	-	-	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.107
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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.035%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+0.002%の▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.060 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

週末3日積みということもあり、本日対比で出合水準は上昇すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月2日	7月3日	7月6日
券	▲1,300	▲800	+1,000
財政	▲31,000	▲24,200	▲33,000
過不足	▲32,300	▲25,000	▲32,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+4,600		
CP等買入	▲200	▲300	
社債等買入		▲100	
ETF買入	+900	+400	
国債補完供給	▲100	+100	
米ドル資金供給用担保国債供給		+36,300	
当座預金増減	▲27,100	+11,400	▲32,000
当座預金残高	4,442,900	4,454,300	4,422,300
準備預金残高	3,831,500	主な需給要因	
積み終了先	3,831,400		
超過準備	3,831,400		
非準備先残高	611,400	国債発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%	国庫短期証券発行・償還(3M)	
平均	56.7%		
乖離率	43.2%		

7月2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
米ドル資金供給(7/7~7/14)	94	94	0.320	0.320		
国債補完供給(7/2~7/3)	91	91	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
7月1日時点 5,652,700	今積期の所要準備額 3,320,800
	7月3日以降の残り所要積数 900
	平均 100

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

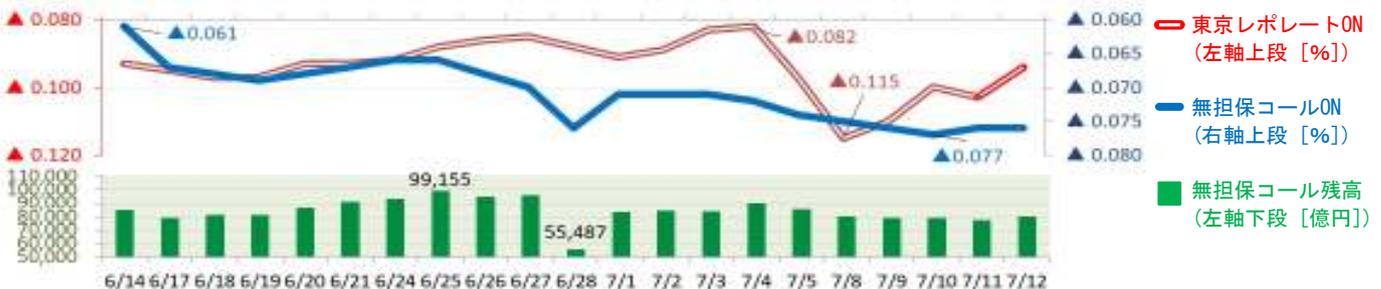
7月3日	3ヶ月	第919回
7月9日	6ヶ月	第920回
7月10日	3ヶ月	
7月16日	1年	
7月7日	30年	
7月9日	5年	
7月21日	20年	
7月28日	40年	

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。