

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年7月3日(金)

短期市場の推移

	6月29日	6月30日	7月1日	7月2日
加重平均金利	▲0.041	▲0.068	▲0.041	▲0.039
東京レポレート(ON)	▲0.060	▲0.062	▲0.071	▲0.090
無コール残	105,131	85,803	94,145	107,297
ON	61,812	64,720	64,117	73,194
その他	43,319	21,083	30,028	34,103
有コール残	21,043	17,950	17,654	18,309

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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00 (欧)5月小売売上高[前月比]	-
-	-	23:00 (米)6月ISM非製造業景況指数	49.1
-	-	-	-

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	▲0.034	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.069
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.060	▲0.075
2W	▲0.075	▲0.005	▲0.049	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.084
1M	-	-	▲0.001	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.104
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▲0.035%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.030%の水準で合出が見られた。大手行を中心とした資金調達ニーズが引き続き強く、加えて3日積みという要因もあり、昨日対比で地合は強含み、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.034%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.055 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

大手行の合出が中心となり、引き続き堅調な地合が継続すると予想。

資金需給

	日銀速報 7月3日	日銀予想 7月6日	当社需給予想 7月7日
券	▲800	▲100	+0
財政	▲24,500	▲34,400	+8,000
過不足	▲25,300	▲34,500	+8,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+9,200
CP等買入	▲300		
社債等買入	▲100		
ETF買入	+400	+1,000	
国債補完供給	+100		
米ドル資金供給用担保国債供給	+36,300		
当座預金増減	+11,100	▲24,300	+8,000
当座預金残高	4,454,000	4,429,700	4,437,700
準備預金残高	3,847,500	主な需給要因	
積み終了先	3,847,400		
超過準備	3,847,400		
非準備先残高	606,500	国庫短期証券 発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	66.7%		
乖離率	33.2%		

7月3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(7/6~)						
1~3年	4,200	12,631	4,206	0.000	0.000	77.5
3~5年	3,500	7,722	3,504	▲0.005	▲0.004	37.4
10~25年	1,200	3,935	1,208	▲0.007	▲0.006	54.5
社債等買入(7/9~)						
	3,000	6,162	3,000	▲0.092	▲0.073	9.0
国債補完供給(7/3~7/6)						
	1	1	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
7月2日時点 5,627,000	今積期の所要準備額 3,320,800
	7月6日以降の残り所要積数 600
	平均 100

国庫短期証券入札予定

7月9日	6ヶ月	第920回
7月10日	3ヶ月	第921回
7月16日	1年	
7月17日	3ヶ月	
7月7日	30年	
7月9日	5年	
7月21日	20年	
7月28日	40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	4,200	3 8 10 17 22 29	7月3日	5
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	1 3 8 17 22 29	7月3日	4
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	7月3日	1
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