

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年7月13日(月)

短期市場の推移

	7月7日	7月8日	7月9日	7月10日
加重平均金利	▲0.027	▲0.023	▲0.021	▲0.017
東京レポレート(ON)	▲0.074	▲0.084	▲0.083	▲0.082
無コール残	99,575	99,657	108,965	110,509
ON	61,587	62,119	71,942	73,546
その他	37,988	37,538	37,023	36,963
有コール残	17,057	17,171	16,500	17,225

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14日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (7月10日現在)	-	21:30	(米)6月消費者物価 コア指数[前年比]
	-	-	-	1.1%
	-	-	-	-

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	▲0.055	0.001	▲0.019	▲0.069
T/N	-	-	-	▲0.062
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.000	▲0.074
2W	-	-	▲0.005	▲0.078
3W	-	-	-	▲0.084
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.176

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.015%の水準で出合が見られた。引き続き国内の幅広い業態による調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.025 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く、堅調な地合が継続すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月13日	7月14日	7月14日	7月15日	7月15日	7月16日
券		+500		+600		+0
財政		▲17,000		▲21,800		▲12,000
過不足		▲16,500		▲21,200		▲12,000
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		+8,800				
共通担保(全店)	▲1,900	+1,900				
CP等買入	▲300		▲500			
国債補完供給		▲200	+200			
新型コロナ対応金融支援特別	▲5,600	+23,300				
当座預金増減		+9,500		▲21,500		▲12,000
当座預金残高		4,473,000		4,451,500		4,439,500
準備預金残高		3,895,200	主な需給要因			
積み終了先		3,895,200				
超過準備		3,895,200				
非準備預金残高		577,800				
準備預金進捗率		99.9%	源泉税揚げ		国債発行償還(個人)	
平均		93.3%				
乖離率		6.6%				

7月13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
国債補完供給(7/13~7/14)	143	143	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
7月10日時点 5,648,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,357,200
7月14日以降の残り所要積数 100
平均 0

国庫短期証券入札予定

7月16日	1年	第922回
7月17日	3ヶ月	第923回
7月21日	6ヶ月	
7月22日	3ヶ月	
7月21日	20年	
7月28日	40年	
7月30日	2年	
8月4日	10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8日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 8 10 17 22 29	7月10日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	1 3 8 17 22 29	7月8日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	6 10 17 22 31	7月10日	3
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	7月10日	1
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