

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年7月14日(火)

## 短期市場の推移

	7月8日	7月9日	7月10日	7月13日
加重平均金利	▲0.023	▲0.021	▲0.017	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.083	▲0.082	▲0.069
無コール残	99,657	108,965	110,509	101,629
ON	62,119	71,942	73,546	65,241
その他	37,538	37,023	36,963	36,388
有コール残	17,171	16,500	17,225	17,605

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
- 政策委員会・金融政策決定会合の決定内容	-	- (米)地区連銀経済報告(ページブック)	-
- 経済・物価情勢の展望(7月、基本的見解)	-	21:30 (米)7月ニューヨーク連銀製造業景気指数	5.5
-	-	22:15 (米)6月鉱工業生産指数[前月比]	4.4%

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	▲0.017	▲0.073
T/N	-	-	-	▲0.075
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.040	▲0.045	▲0.077
2W	-	-	-	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.086
1M	▲0.050	▲0.015	▲0.021	▲0.093
2M	-	-	▲0.040	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.157
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業協会公表

## 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▲0.020%~▲0.015%の水準で出合が見られた。引き続き都銀・信託業態を中心とした調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.017%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.015

## 翌営業日のマーケット

積み最終日ということもあり、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 7月14日	日銀予想 7月15日	当社需給予想 7月16日
券	+600	+100	▲1,000
財政	▲22,700	▲16,300	+3,000
過不足	▲22,100	▲16,200	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+30,000
CP等買入	▲500	▲400	
社債等買入		▲100	
国債補完供給	+200		
米ドル資金供給用担保国債供給		▲4,400	
当座預金増減	▲22,400	+8,900	+2,000
当座預金残高	4,450,600	4,459,500	4,461,500
準備預金残高	3,868,900		
積み終了先	3,868,800		
超過準備	3,868,800		
非準備預金残高	581,700		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	96.7%		
乖離率	3.3%		

## 7月14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
国庫短期証券買入(7/15~)	30,000	56,277	30,002	0.001	0.010	71.8
米ドル資金供給(7/16~7/30)		11,860	11,860	0.340	0.340	
米ドル資金供給(7/16~10/8)		6,970	6,970	0.320	0.320	
国債補完供給(7/14~7/15)		0	0			
米ドル資金供給用担保国債供給(7/15~7/31)		1	1	▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(7/15~10/9)		5,000	2,135	2.135	▲0.100	▲0.100
米ドル資金供給用担保国債供給(7/15~10/9)		5,000	2,163	2.163	▲0.100	▲0.100

マナタリーベース [億円]  
7月13日時点 5,657,100

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,357,200  
7月15日以降の残り所要積数 0  
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	第924回
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。