

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年7月16日(木)

短期市場の推移

	7月10日	7月13日	7月14日	7月15日
加重平均金利	▲0.017	▲0.019	▲0.017	▲0.014
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.069	▲0.073	▲0.074
無コール残	110,509	101,629	99,894	98,438
ON	73,546	65,241	63,256	64,610
その他	36,963	36,388	36,638	33,828
有コール残	17,225	17,605	15,850	15,986

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	主要銀行貸出動向アンケート調査(7月)	-	21:30	(米)6月住宅着工件数	118万戸
	-		21:30	(米)6月住宅建設許可件数	130.0万戸
	-		23:00	(米)7月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	80.0

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	▲0.075	0.001	▲0.050	▲0.072
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.010	▲0.030	▲0.079
2W	▲0.045	0.000	▲0.036	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.089
1M	▲0.050	▲0.025	▲0.033	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.175

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▲0.045%~▲0.065%の水準で出合が見られた。新積み期に入ったこともあり、前日より出合水準は低下し同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.036%の▲0.050%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.065 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなる明日は、本日より出合水準が上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月16日	7月17日	7月17日	7月20日	7月20日	7月20日
券	▲1,200	▲800	▲800	+1,000		
財政	+1,600	+8,300	+8,300	▲12,000		
過不足	+400	+7,500	+7,500	▲11,000		
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
CP等買入			▲400			
社債等買入			▲300			
ETF買入	+100					
被災地金融機関支援			▲1,100	+100		
米ドル資金供給用担保国債供給			+23,700			
当座預金増減	+500	+29,500	+29,500	▲11,000		
当座預金残高	4,460,200	4,489,700	4,489,700	4,478,700		
準備預金残高	3,874,600					
積み終了先	2,473,600					
超過準備	1,052,600					
非準備先残高	585,600					
準備預金進捗率	81.3%					
平均	3.2%					
乖離率	78.0%					

7月16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(7/20~8/3)	0	0	0	0.340	0.340	
国債補完供給(7/16~7/17)	5	5	▲0.350	▲0.350		
	0	0	0			

マナタリーベース [億円]
7月15日時点 5,643,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,473,200
7月17日以降の残り所要積数 651,200
平均 21,700

国庫短期証券入札予定

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	第925回
7月31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7月積み期 [7月16日~8月15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。