

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年7月27日(月)

短期市場の推移

[億円][%]

	7月17日	7月20日	7月21日	7月22日
加重平均金利	▲0.037	▲0.035	▲0.030	▲0.028
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.066	▲0.069	▲0.073
無コール残	98,409	103,824	107,450	99,658
ON	65,691	69,811	71,702	65,210
その他	32,718	34,013	35,748	34,448
有コール残	18,141	17,723	17,885	17,218

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28日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	企業向けサービス価格指数(6月)	-	23:00	(米)7月消費者信頼感指数	96.5
	-			FOMC(29日まで)	
	-			-	

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

本日の市況

	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	▲0.070	0.001	▲0.028	▲0.073
T/N	-	-	-	▲0.071
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.000	▲0.019	▲0.072
2W	-	-	▲0.025	▲0.078
3W	▲0.045	0.050	▲0.009	▲0.083
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.180

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

本日の無担保コールON物は▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.025%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▲0.001%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、堅調な地合を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 7月27日	日銀予想 7月28日	当社需給予想 7月29日
券	+1,000	+800	+0
財政	▲46,700	+1,900	▲3,000
過不足	▲45,700	+2,700	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+12,200	+2,500	スタート
共通担保(全店)	▲1,900		
CP等買入	▲700	▲400	
社債等買入		+2,000	
ETF買入	+100	+400	
当座預金増減	▲32,900	+7,200	▲3,000
当座預金残高	4,509,000	4,516,200	4,513,200
準備預金残高	3,914,700	主な需給要因	
積み終了先	3,914,200		
超過準備	3,914,000		
非準預先残高	594,300		
準備預金進捗率	99.9%		国債発行(40年)
平均	38.7%		
乖離率	61.2%		

7月27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(7/28~)						
~1年	1,000	2,542	1,004	0.007	0.009	16.1
10~25年	1,200	3,942	1,213	0.005	0.007	4.4
国債補完供給(7/27~7/28)						
		44	44	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
7月22日時点 5,686,800	今積期の所要準備額 3,473,200
	7月28日以降の残り所要積数 2,100
	平均 100

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

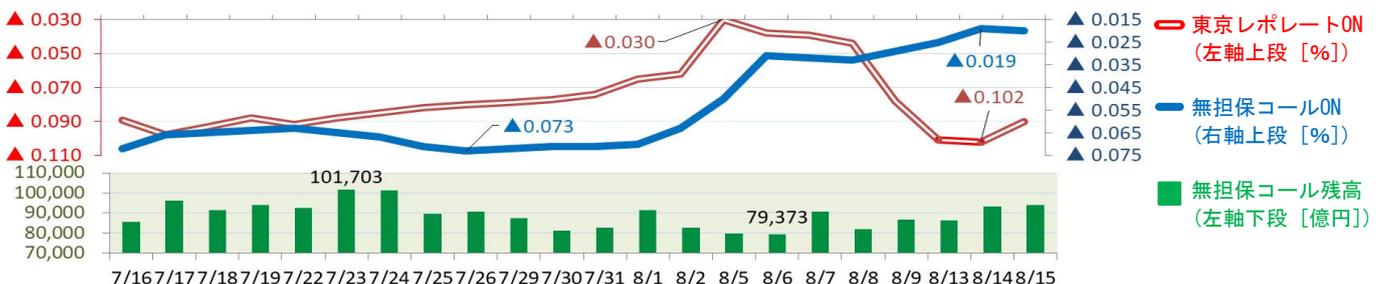
7月31日	3ヶ月	第926回
8月6日	6ヶ月	
8月7日	3ヶ月	
8月14日	3ヶ月	
国債入札予定		
7月28日	40年	
7月30日	2年	
8月4日	10年	
8月6日	物価連動	

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27日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 8 10 17 22 29	7月22日	1
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	1 3 8 17 22 29	7月22日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	6 10 17 22 31	7月22日	1
10年超25年以下	500~2,000	1,200	3 27	7月27日	0
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	7月17日	1
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。