

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年7月28日(火)

短期市場の推移

	7月20日	7月21日	7月22日	7月27日
加重平均金利	▲0.035	▲0.030	▲0.028	▲0.028
東京レポレート(ON)	▲0.066	▲0.069	▲0.073	▲0.073
無コール残	103,824	107,450	99,658	90,836
ON	69,811	71,702	65,210	58,573
その他	34,013	35,748	34,448	32,263
有コール残	17,723	17,885	17,218	17,915

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:30	【講演】両宮副総裁 (日本記者クラブ)	(米)週間MBA 住宅ローン申請指数	-
	-	(米)パウエル議長会見	-
	-	-	-

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	▲0.065	0.001	▲0.026	▲0.069
T/N	-	-	-	▲0.074
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.073
2W	▲0.030	▲0.025	▲0.028	▲0.078
3W	-	-	0.050	▲0.083
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.181

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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.020%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+0.002%の▲0.026%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.030	▲0.030 ~ ▲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

	日銀速報 7月28日	日銀予想 7月29日	当社需給予想 7月30日
券	+900	▲200	+0
財政	+1,100	+5,600	+5,000
過不足	+2,000	+5,400	+5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+25,000
国債買入			
CP等買入	▲400	▲100	
社債等買入		▲100	
ETF買入			+700
米ドル資金供給用担保国債供給			▲1,500
当座預金増減	+6,500	+29,400	+5,000
当座預金残高	4,515,500	4,544,900	4,549,900
準備預金残高	3,924,200	主な需給要因	
積み終了先	3,923,800		
超過準備	3,923,800		
非準預先残高	591,300	国債発行(40年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	41.9%		
乖離率	58.0%		

7月28日のオペ結果

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(7/29~)	25,000	67,865	25,005	0.005	0.007	31.5
米ドル資金供給(7/30~8/6)		4,023	4,023	0.330	0.330	
米ドル資金供給(7/30~10/22)		770	770	0.320	0.320	
国債補完供給(7/28~7/29)		10	10	▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(7/29~8/7)		5,000	1,434	1,434	▲0.100	▲0.100

マナタリーベース [億円]
7月27日時点 5,698,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,473,200
7月29日以降の残り所要積数 1,700
平均 100

国庫短期証券入札予定

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	
7月30日	2年	
8月4日	10年	
8月6日	物価運動	
8月18日	30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
物価運動債	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。 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