

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年7月30日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月22日	7月27日	7月28日	7月29日
加重平均金利	▲0.028	▲0.028	▲0.026	▲0.023
東京レポレート(ON)	▲0.073	▲0.073	▲0.069	▲0.097
無コール残	99,658	90,836	92,559	91,784
ON	65,210	58,573	60,196	59,711
その他	34,448	32,263	32,363	32,073
有コール残	17,218	17,915	17,960	16,558

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31日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	6月有効求人倍率・完全失業率	-	18:00	(欧)4-6月期域内総生産(GDP)速報値[前年比]
8:50	6月鉱工業生産指数[前月比]	-	21:30	(米)6月個人消費支出
8:50	金融政策決定会合議事録等(2010年1月~6月開催分)	-	-	(米)7月ミシガン消費者信頼感指数(確報)

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	▲0.060	0.001	▲0.020	▲0.082
T/N	-	-	▲0.080	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.078
2W	▲0.035	0.001	▲0.020	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.084
1M	▲0.030	0.000	▲0.020	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.157
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。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.020%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲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意欲は強く、堅調な地合を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月30日	7月31日	7月31日	8月1日	8月3日	8月3日
券	▲200	+400	+400	+1,000	+1,000	
財政	+4,400	+9,700	+9,700	▲34,000	▲34,000	
過不足	+4,200	+10,100	+10,100	▲33,000	▲33,000	
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		+8,100				
CP等買入	▲100		▲4,200	+6,000		
ETF買入		+900		+800		
米ドル資金供給用担保国債供給			+2,200			
国債補完供給	+100					
当座預金増減	+13,200	+14,900	+14,900	▲33,000	▲33,000	
当座預金残高	4,559,000	4,573,900	4,573,900	4,540,900	4,540,900	
準備預金残高	3,944,900	主な需給要因				
積み終了先	3,944,800					
超過準備	3,944,700	国債発行・償還(2年)				
非準備先残高	614,100	国庫短期証券発行・償還(3M)				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	48.4%					
乖離率	51.5%					

7月30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(8/3~8/11)	0	0	0.330	0.330		
国債補完供給(7/30~7/31)	27	27	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
7月29日時点 5,734,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,473,200
7月31日以降の残り所要積数 1,200
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	第927回
8月7日	3ヶ月	
8月14日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月4日	10年	
8月6日	物価運動	
8月18日	30年	
8月20日	5年	

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29日	0
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	1 3 8 17 22 29	7月29日	0
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29日	0
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