

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年8月4日(火)

短期市場の推移

	7月29日	7月30日	7月31日	8月3日
加重平均金利	▲0.023	▲0.020	▲0.021	▲0.020
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.082	▲0.073	▲0.065
無コール残	91,784	92,669	102,992	88,993
ON	59,711	60,346	72,104	57,385
その他	32,073	32,323	30,888	31,608
有コール残	16,558	18,322	17,254	18,137

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。

8月5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
21:15	-	21:30	(米)6月貿易収支
		23:00	(米)7月ISM非製造業景況指数
			55.0

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	▲0.060	0.001	▲0.021	▲0.067
T/N	-	-	▲0.001	▲0.073
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.000	▲0.013	▲0.072
2W	-	-	▲0.005	▲0.076
3W	-	-	-	▲0.081
1M	-	-	-	▲0.090
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
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▲0.020%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▲0.001%の▲0.021%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲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

	日銀速報 8月4日	日銀予想 8月5日	当社需給予想 8月6日
券	+500	+500	+0
財政	▲58,600	▲25,900	▲2,000
過不足	▲58,100	▲25,400	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+20,000
国債買入	+4,500	▲200	
CP等買入			
ETF買入	+100	+100	
国債補完供給	▲600	+600	
米ドル資金供給用担保国債供給			▲1,700
当座預金増減	▲54,100	▲6,600	▲2,000
当座預金残高	4,478,500	4,471,900	4,469,900
準備預金残高	3,901,700	主な需給要因	
積み終了先	3,901,700	国債発行(10年)	
超過準備	3,901,700		
非準備先残高	576,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	64.5%		
乖離率	35.4%		

8月4日のオペ結果 [元][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(8/5~)	20,000	44,510	20,002	0.008	0.010	69.0
米ドル資金供給(8/6~8/13)		3,647	3,647	0.330	0.330	
米ドル資金供給(8/6~10/29)		370	370	0.320	0.320	
国債補完供給(8/4~8/5)		625	625	▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(8/5~8/14)		5,000	1,626	1,626	▲0.100	▲0.100

マナタリーベース [億円]
8月3日時点 5,720,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,473,200
8月5日以降の残り所要積数 600
平均 100

国庫短期証券入札予定

8月6日	6ヶ月	第927回
8月7日	3ヶ月	第928回
8月14日	3ヶ月	
8月19日	1年	
国債入札予定		
8月6日	物価連動	
8月18日	30年	
8月20日	5年	
8月25日	20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	3
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 7 13 21 26 31	8月3日	5
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	5 13 19 24 26 31	7月29日	6
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	7 13 19 21 26	7月31日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 28	7月27日	2
25年超	0~500	300	21 28	7月31日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	8月3日	1
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	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。