

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年8月6日(木)

短期市場の推移

	7月31日	8月3日	8月4日	8月5日
加重平均金利	▲0.021	▲0.020	▲0.021	▲0.022
東京レポレート(ON)	▲0.073	▲0.065	▲0.067	▲0.063
無コール残	102,992	88,993	92,615	85,175
ON	72,104	57,385	60,857	53,617
その他	30,888	31,608	31,758	31,558
有コール残	17,254	18,137	19,227	19,228

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7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
15:00	コール市場残高(7月)	-	21:30	(米)7月非農業部門雇用者数 163.5万人
	-		21:30	(米)7月失業率 10.5%
	-			

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	▲0.055	0.001	▲0.022	▲0.061
T/N	-	-	▲0.001	▲0.063
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.070
2W	-	-	▲0.015	▲0.074
3W	-	-	-	▲0.077
1M	-	-	-	▲0.085
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.178

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)は前営業日対比横ばいの▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.025	▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

週末4日積となるため出合の水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月6日	8月7日	8月11日
券	▲700	▲400	+1,000
財政	▲900	+5,400	▲32,000
過不足	▲1,600	+5,000	▲31,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+6,000		
共通担保(全店)			▲3,100
CP等買入	▲100	▲700	
社債等買入		+3,000	
ETF買入	+100	+600	
当座預金増減	+4,400	+7,900	▲34,100
当座預金残高	4,475,500	4,483,400	4,449,300
準備預金残高	3,895,800	主な需給要因	
積み終了先	3,895,700		
超過準備	3,895,700		
非準備先残高	579,700		
準備預金進捗率	99.9%	国債発行	国庫短期証券
平均	71.0%	(10年物価連動債)	発行・償還(3M・6M)
乖離率	28.9%		

8月6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(8/11~8/17)						
	0	0	0	0.340	0.340	
国債補完供給(8/6~8/7)						
	3	3	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
8月5日時点 5,658,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,473,200
8月7日以降の残り所要積数 500
平均 100

国庫短期証券入札予定

8月7日	3ヶ月	第928回
8月14日	3ヶ月	
8月19日	1年	
8月21日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月18日	30年	
8月20日	5年	
8月25日	20年	
8月27日	2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	8月5日	5
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	8月5日	1
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	8月5日	0

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