

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年8月7日(金)

短期市場の推移

	8月3日	8月4日	8月5日	8月6日
加重平均金利	▲0.020	▲0.021	▲0.022	▲0.022
東京レポレート(ON)	▲0.065	▲0.067	▲0.063	▲0.061
無コール残	88,993	92,615	85,175	92,956
ON	57,385	60,857	53,617	61,298
その他	31,608	31,758	31,558	31,658
有コール残	18,137	19,227	19,228	19,276

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11日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	6月国際収支(経常収支)	1326億円	21:30	(米)7月生産者物価コア指数[前年比]	0.0%
		-		-	-
		-		-	-

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	▲0.055	0.001	▲0.020	▲0.063
T/N	-	-	▲0.001	▲0.057
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.000	▲0.020	▲0.066
2W	▲0.033	▲0.005	▲0.024	▲0.071
3W	▲0.030	0.020	▲0.005	▲0.076
1M	-	-	-	▲0.083
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.097
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.175

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+0.002%の▲0.020%となった。
また日本銀行は当座預金のマクロ加算残高にかかる基準比率の見直しを行い、8月積み期の基準比率を前積み期対比▲2.5%の29.0%とした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	▲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		日銀予想		当社需給予想	
	8月7日	8月11日	8月11日	8月12日	8月12日	8月12日
券		▲400		+500		+0
財政		+6,200		▲30,000		+2,000
過不足		+5,800		▲29,500		+2,000
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				+9,500		
共通担保(全店)			▲3,100	+2,900		
CP等買入	▲700		▲300			
社債等買入		+3,000				
ETF買入		+600				
米ドル資金供給用担保国債供給		+2,500				
当座預金増減		+11,200		▲20,500		+2,000
当座預金残高		4,486,700		4,466,200		4,468,200
準備預金残高		3,895,700	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		591,000				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		83.9%				
乖離率		16.0%				

8月7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(8/11~)						
~1年	1,000	3,504	1,000	0.009	0.013	24.2
1~3年	4,200	14,081	4,210	0.003	0.003	84.6
5~10年	4,200	8,754	4,203	▲0.005	▲0.004	90.6
米ドル資金供給(8/11~8/17)						
			0	0	0.340	0.340
国債補完供給(8/7~8/11)						
			4	4	▲0.350	▲0.350
			0	0		
共通担保(全店)(8/11~8/24)						
	20,000	2,851	2,851			

マナタリーベース [億円]
8月6日時点 5,663,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,491,600
8月11日以降の残り所要積数 200
平均 0

国庫短期証券入札予定

8月14日	3ヶ月	第929回
8月19日	1年	
8月21日	3ヶ月	
8月24日	6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	8月7日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 7 13 21 26 31	8月7日	4
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	8月7日	4
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。