

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年8月13日(木)

短期市場の推移

	8月6日	8月7日	8月11日	8月12日
加重平均金利	▲0.022	▲0.020	▲0.020	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.061	▲0.063	▲0.055	▲0.064
無コール残	92,956	97,767	93,538	97,350
ON	61,298	66,309	63,690	67,402
その他	31,658	31,458	29,848	29,948
有コール残	19,276	19,222	19,681	19,765

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00 (欧)6月貿易収支	-
-	-	22:15 (米)7月鉱工業生産指数 [前月比]	2.7%
-	-	23:00 (米)8月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	71.0

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	▲0.050	0.001	▲0.016	▲0.089
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.004	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.081
2W	-	-	-	▲0.077
3W	-	-	-	▲0.081
1M	▲0.030	▲0.020	▲0.023	▲0.086
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.097
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.173

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▲0.018%の出合から始まり、その後は主に▲0.018%~▲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▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.016	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.035 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

大手行を中心に堅調な地合が継続すると予想。

資金需給

	日銀速報 8月13日	日銀予想 8月14日	当社需給予想 8月17日
券	▲400	+100	+1,000
財政	▲6,800	+76,200	▲19,000
過不足	▲7,200	+76,300	▲18,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+30,000	-	-
国債買入	-	+12,100	-
CP等買入	▲1,200	▲200	-
ETF買入	-	+200	-
国債補完供給	+800	+300	-
新型コロナ対応金融支援特別	-	▲86,800	+49,400
米ドル資金供給用担保国債供給	-	+1,700	-
当座預金増減	+22,100	+53,000	▲18,000
当座預金残高	4,483,900	4,536,900	4,518,900
準備預金残高	3,891,100	3,891,100	3,891,100
積み終了先	3,891,100	3,891,100	3,891,100
超過準備	3,891,100	3,891,100	3,891,100
非準備先残高	592,800	592,800	592,800
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%
平均	93.5%	93.5%	93.5%
乖離率	6.4%	6.4%	6.4%

8月13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
国債買入(8/14~)						
1~3年	4,200	10,134	4,204	▲0.005	▲0.005	76.5
3~5年	3,500	9,604	3,507	▲0.005	▲0.005	61.2
5~10年	4,200	6,181	4,204	▲0.012	▲0.008	76.3
米ドル資金供給(8/17~8/24)						
0	0	0	0.340	0.340		
国債補完供給(8/13~8/14)						
311	311	▲0.350	▲0.350			
0	0					
新型コロナ対応金融支援特別(8/14~2/26)						
49,410	49,410					

マナタリーベース [億円]
8月12日時点 5,649,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,491,600
8月14日以降の残り所要積数 100
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	第930回
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13日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	5 13 19 24 26 31	8月13日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	7 13 19 21 26	8月13日	3
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	#VALUE!

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。