



デイリーシグナル

2021年7月29日(木)

短期市場の推移

	7月21日	7月26日	7月27日	7月28日
加重平均金利	▲0.038	▲0.038	▲0.039	▲0.041
東京レポレート(TN)	▲0.091	▲0.090	▲0.091	▲0.088
無コール残	154,517	142,328	140,200	137,520
ON	95,121	82,472	79,924	76,144
その他	59,396	59,856	60,276	61,376
有コール残	19,737	20,641	20,094	20,923

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。

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	▲0.070	0.001	▲0.043	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.040	0.000	▲0.029	▲0.090
2W	-	-	▲0.030	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.096
1M	▲0.025	▲0.013	▲0.021	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.129

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

7月30日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	6月失業率	+3.0%	18:00	(欧)7月消費者物価コア指数 [前年比]
8:50	6月鉱工業生産指数 [前月比]	+5.0%	18:00	(欧)4-6月期域内総生産(GDP)速報値[前年比]
8:50	金融政策決定会議記録等 (2011年1月~6月開催分)	-	21:30	(米)6月個人消費支出(PCE)価格コア指数[前年比]

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.030%の水準で出合が見られた。地銀業態の一部が調達量を抑えたため、同加重平均金利は前日対比▲0.002%の▲0.043%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	-	▲0.060 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの一部が資金調達を控えるため、出合水準は本日対比でやや低下と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月29日		7月30日		8月2日	
券	▲800		+300		+1,000	
財政	+2,100		+13,500		▲16,000	
過不足	+1,300		+13,800		▲15,000	
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	+10,400					
CP等買入	▲100		▲3,900		+5,000	
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+500		▲100		+100	
当座預金増減	+12,000		+14,900		▲15,000	
当座預金残高	5,372,300		5,387,200		5,372,200	
準備預金残高	4,675,400		主な需給要因			
積み終了先	4,675,000		国庫短期証券			
超過準備	4,675,000		発行・償還(3M)			
非準備先残高	696,900		国債発行・償還(2Y)			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	45.2%					
乖離率	54.7%					

7月29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	按分
国債補完供給(7/29~7/30)	106	106	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
7月28日時点 6,579,700

所要	今積期の所要準備額
7月30日以降の残り所要	3,747,800
積数	1,300
平均	100

国庫短期証券入札予定

7月30日	3ヶ月	第1012回
8月5日	6ヶ月	第1013回
8月6日	3ヶ月	
8月13日	3ヶ月	

国債入札予定

8月3日	10年
8月5日	物価連動
8月11日	30年
8月24日	5年

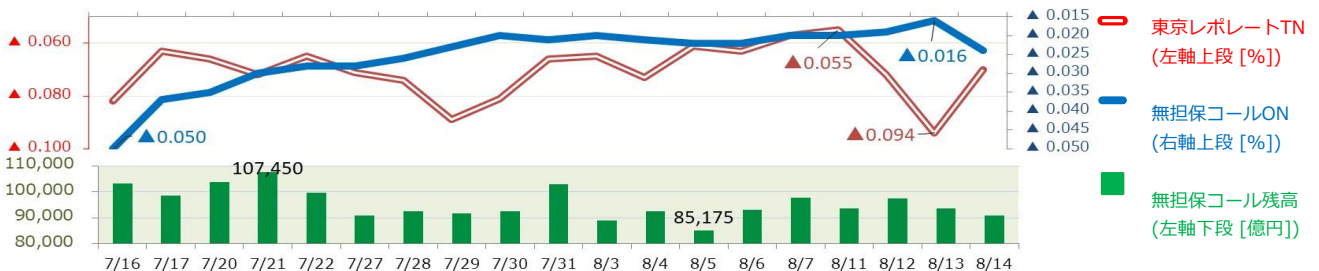
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回程度	7月28日	0
1年超3年以下	4500	4,500	2 7 14 21	7月21日	0
3年超5年以下	4500	4,500	2 14 21 28	7月28日	0
5年超10年以下	4250	4,250	7 14 21 28	7月28日	0
10年超25年以下	1500	1,500	2	7月2日	0
25年超	500	500	14	7月14日	0
物価連動債	600	600	月1回程度	7月21日	0
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月7日	-

1年前の市場推移

○2020年7月積み期 [7月16日~8月14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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会