上田八木短資

デイリーシグナル

2024年6月28日(金)

短期市場の推移 [億円] [%]

	6月24日	6月25日	6月26日	6月27日
加重平均金利	0.081	0.078	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.086	0.084	0.052	▲0.061
無コール残	86,750	81,627	79,744	79,177
ON	40,101	35,168	33,545	33,908
その他	46,649	46,459	46,199	45,269
有コール残	37,748	37,581	37,680	37,508

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。

7月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀短観（6月調査）			-	
	-			-	
	-			-	

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	0.079	0.076	0.028
T/N	-	-	-	0.047
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.049
2W	-	-	0.150	0.049
3W	-	-	-	0.049
1M	0.190	0.270	0.212	0.051
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.084
6M	-	-	-	0.139
1Y	-	-	-	0.200

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

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後は主に0.075%～0.078%を中心に取引された。期末要因による取り控えによりギブン地合いとなり、ON物加重平均金利（速報）は前営業日対比▲0.001%低下の0.076%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ～ -	- ～ -	0.075 ～ 0.078

翌営業日のマーケット

期末要因の剥落によりビッドサイドの調達意欲が戻ることが想定されるため、出合いの水準は本日対比上昇を予想する。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月28日		7月1日		7月2日	
券		▲200		+500		+0
財政		▲9,200		▲14,600		▲13,000
過不足		▲9,400		▲14,100		▲13,000
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				+6,700		
CP等買入	▲3,000	+3,000				
国債補完供給	+26,600	▲25,400	+25,400			
当座預金増減		▲8,200		+18,000		▲13,000
当座預金残高		5,517,800		5,535,800		5,522,800
準備預金残高		4,905,300	主な需給要因			
積み終了先		4,905,200	国庫短期証券発行償還（3M）			
超過準備		4,905,100				
非準預先残高		612,500	国債発行償還（2年）			
準備預金進捗率		99.9%				
平均		50.0%				
乖離率		49.9%				

6月28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
国債買入(7/1～)						
3～5年	4,250	7,656	4,252	0.001	0.003	100.0
10～25年	1,500	2,719	1,506	0.000	0.004	14.5
25年～	750	1,394	752	0.004	0.007	47.1
物価連動	600	1,550	600	▲0.370	▲0.519	
国債補完供給(6/28～7/1)						
	25,907	25,907	▲0.350	▲0.350		
	246	246	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]

6月27日時点	6,762,000

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,942,000
7月1日以降の残り所要	
積数	700
平均	0

国庫短期証券入札予定

7月5日	3ヶ月(第1241回)
7月9日	6ヶ月
7月12日	3ヶ月
7月18日	1年

国債入札予定

7月2日	10年
7月4日	30年
7月9日	5年
7月11日	20年

来月の国債買入オペ予定 [億円]

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						6月7日	1
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	3	10	17	23			6月24日	4
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	3	10	23	29			6月28日	4
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	10	17	23	29			6月24日	4
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	3	17	29				6月28日	3
25年超	500~1,000	750	10	29					6月28日	2
物価連動債	600	600	月1回						6月28日	1
変動利付債	-	300	-						4月14日	-

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