



デイリーシグナル

2024年7月31日(水)

短期市場の推移

	7月25日	7月26日	7月29日	7月30日
加重平均金利	0.081	0.078	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.033	0.078	0.074	0.006
無コール残	78,049	74,593	77,626	75,242
ON	32,827	29,381	32,694	30,310
その他	45,222	45,212	44,932	44,932
有コール残	37,144	35,822	36,208	36,077

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	0.280	0.079	▲0.062
T/N	-	-	-	0.100
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.350	0.110
2W	0.300	0.350	0.321	0.111
3W	-	-	0.330	0.112
1M	0.340	0.350	0.343	0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.345	0.138
6M	-	-	-	0.176
1Y	-	-	-	0.230

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

8月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) 7月の製造業PMI (確報)	
		(欧) 7月の製造業PMI (確報)	

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。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.002%上昇の0.079%となった。また、本日の金融政策決定会合では政策金利の0.25%程度への引き上げ、国債買入の減額が決定された。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

出し手・取り手ともに様子見姿勢から入ると思われるが、付利金利との裁定を意識したレートに収束し、0.22%~0.23%近辺の取引を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月31日	8月1日	8月1日	8月2日	8月2日	8月2日
券	+0		+0		+0	
財政	▲9,400		+2,300		▲54,000	
過不足	▲9,400		+2,300		▲54,000	
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
CP等買入	▲800	+3,000				
社債等買入	▲300					
国債補完供給	+20,400	▲23,200	+23,200			
当座預金増減	▲10,300		+25,500		▲54,000	
当座預金残高	5,484,800		5,510,300		5,456,300	
準備預金残高	4,896,500		主な需給要因			
積み終了先	4,896,400		国債発行償還(2年)		法人税・消費税・保	
超過準備	4,896,400				険揚げ	
非準備先残高	588,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	51.6%					
乖離率	48.3%					

7月31日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(7/31~8/1)	23,905	23,905	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
7月30日時点 6,741,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,082,100
8月1日以降の残り所要	
積数	900
平均	100

国債短期証券入札予定

8月2日	3ヶ月(第1247回)
8月8日	6ヶ月
8月9日	3ヶ月
8月16日	3ヶ月

来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	7月3日	1
1年超3年以下	3500	3,750	2 7 15 21	7月23日	4
3年超5年以下	3750	4,250	2 7 21 28	7月29日	4
5年超10年以下	4000	4,250	2 15 21 28	7月29日	4
10年超25年以下	1500	1,500	7 15 28	7月29日	3
25年超	750	750	15 28	7月29日	2
物価連動債	600	600	月1回	7月29日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

国債入札予定

8月6日	10年
8月8日	30年
8月14日	5年
8月16日	物価連動

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