



デイリーシグナル

2021年6月29日(火)

短期市場の推移

	6月23日	6月24日	6月25日	6月28日
加重平均金利	▲0.028	▲0.028	▲0.029	▲0.030
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.086	▲0.085	▲0.083
無コール残	141,330	143,097	149,200	122,785
ON	79,239	82,206	87,764	61,779
その他	62,091	60,891	61,436	61,006
有コール残	21,258	20,357	20,903	22,491

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	▲0.029	▲0.082
T/N	-	-	0.000	▲0.095
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	-	-	0.000	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.089
3W	-	-	0.000	▲0.092
1M	-	-	-	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.113
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

6月30日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	5月鉱工業生産指数 [前月比]	▲2.0%	15:00	(英) GDP改定値 (1-3月)	-6.1%
-	-	-	18:00	(欧)6月消費者物価コア指数[前年比]	0.9%
-	-	-	21:15	(米)6月ADP全米雇用報告	53.0万人

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▲0.020%の合出から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.015%の水準で合出が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.045 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

四半期末越えの取引となり、調達を一部控える動きも予想されるため、合出水準は本日対比低下と思われる。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月29日	6月30日	6月30日	7月1日	7月1日	7月1日
券	▲1,000	▲300	▲300	▲300	▲300	+0
財政	+2,400	+9,700	+9,700	+9,700	+9,700	▲22,000
過不足	+1,400	+9,400	+9,400	+9,400	+9,400	▲22,000
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
国庫短期証券買入				+12,500		
国債買入		+9,600				
CP等買入	▲500		▲3,000	+5,000		
国債補完供給		▲100		+100		
当座預金増減	+10,400	+24,000	+24,000	+24,000	+24,000	▲22,000
当座預金残高	5,354,300	5,378,300	5,378,300	5,378,300	5,378,300	5,356,300
準備預金残高	4,704,300	4,704,300	4,704,300	4,704,300	4,704,300	4,704,300
積み終了先	4,704,000	4,704,000	4,704,000	4,704,000	4,704,000	4,704,000
超過準備	4,704,000	4,704,000	4,704,000	4,704,000	4,704,000	4,704,000
非準備先残高	650,000	650,000	650,000	650,000	650,000	650,000
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	46.7%	46.7%	46.7%	46.7%	46.7%	46.7%
乖離率	53.2%	53.2%	53.2%	53.2%	53.2%	53.2%

6月29日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(6/30~)	12,500	42,489	12,501	0.004	0.004	100.0
米ドル資金供給(7/1~7/9)	0	0	0.340	0.340		
米ドル資金供給(7/1~9/24)	0	0	0.340	0.340		
国債補完供給(6/29~6/30)	59	59	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
6月28日時点 6,558,800

所要	今積期の所要準備額
6月30日以降の残り所要	3,632,600
積数	1,300
平均	100

国庫短期証券入札予定

7月2日	3ヶ月 第1005回
7月8日	6ヶ月
7月9日	3ヶ月
7月15日	3ヶ月

国債入札予定

7月1日	10年
7月6日	30年
7月8日	5年
7月13日	20年

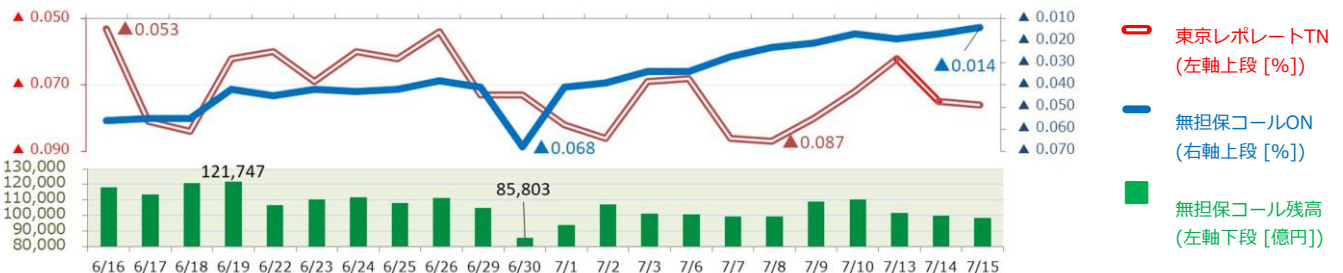
今月の国債買入オペ予定

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	6月23日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 9 16 23	6月23日	0
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 16 28	6月28日	0
5年超10年以下	4500	4,500	9 16 23 28	6月28日	0
10年超25年以下	2000	2,000	2	6月2日	0
25年超	500	500	28	6月28日	0
物価運動債	600	600	月1回程度	6月9日	0
変動利付債<四半期>	300	300	-	4月21日	-

1年前の市場推移

○2020年6月積み期 [6月16日~7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。 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