



## デイリーシグナル

2021年6月30日(水)

### 短期市場の推移

	6月24日	6月25日	6月28日	6月29日
加重平均金利	▲0.030	▲0.030	▲0.029	▲0.029
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.083	▲0.095	▲0.095
無コール残	122,785	122,785	129,690	129,690
ON	61,779	61,779	70,094	70,094
その他	61,436	61,006	59,596	59,596
有コール残	20,903	22,491	20,672	20,672

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.086	0.001	▲0.050	▲0.089
T/N			▲0.001	▲0.082
S/N			▲0.015	-
1W	▲0.025	▲0.008	▲0.019	▲0.085
2W			▲0.020	▲0.087
3W				▲0.090
1M	▲0.025	0.000	▲0.018	▲0.095
2M				-
3M				▲0.100
6M				▲0.113
1Y				▲0.129

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

### 7月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	4-6月期日銀短観(大企業製造業DI)	17	9:30	(米)6月製造業PMI(確報)	
	-		23:00	(米)6月ISM製造業景況指数	61.0
	-			-	

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▲0.050%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.035%の水準で合出が見られた。ビッドサイドは四半期末越えの取引を避ける先が多く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.021%の▲0.050%と2020年9月以来の低水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.020

### 翌営業日のマーケット

本日調達を控えていたビッドサイドが調達を再開し、合出水準は本日対比で大きく上昇すると予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月30日	7月1日	7月1日	7月2日	7月2日	7月2日
券		▲300		▲900		▲1,000
財政		+11,600		▲25,100		▲62,000
過不足		+11,300		▲26,000		▲63,000
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				
CP等買入	▲3,000	+5,000				
国債補完供給	+100	▲1,100	+1,100			
当座預金増減		+24,800		▲24,900		▲63,000
当座預金残高		5,379,100		5,354,200		5,291,200
準備預金残高		4,709,300	主な需給要因			
積み終了先		4,709,000	国債発行償還(2年)		法人税・消費税・保険	
超過準備		4,709,000			揚げ	
非準備先残高		669,800			国債発行(10年)	
準備預金進捗率		99.9%				
平均		50.0%				
乖離率		49.9%				

### 6月30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(6/30~7/1)	1,059	1,059	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース (億円)  
 6月29日時点 6,570,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,632,600
7月1日以降の残り所要	
積数	900
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	

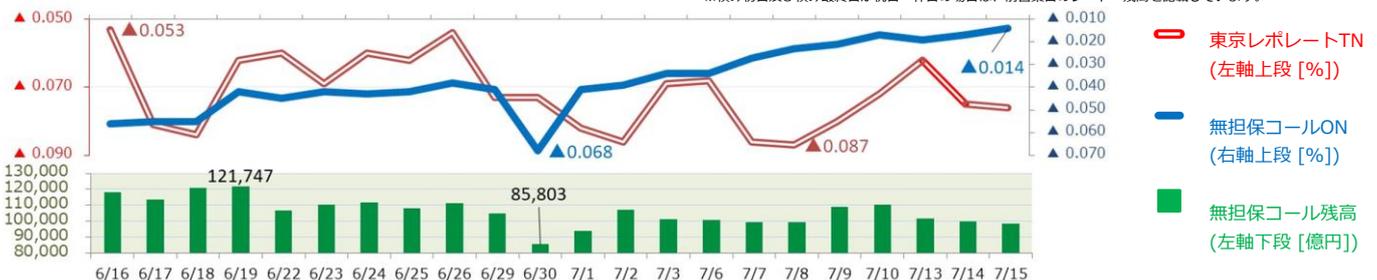
### 来月の国債買入オペ予定

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	6月23日	1
1年超3年以下	4500	4,750	2 7 14 21	6月23日	4
3年超5年以下	4500	4,500	2 14 21 28	6月28日	4
5年超10年以下	4250	4,500	7 14 21 28	6月28日	4
10年超25年以下	1500	2,000	2	6月2日	4
25年超	500	500	14	6月28日	1
物価連動債	600	600	月1回	6月9日	1
変動利付債<四半期>	300	300	7月7日	4月21日	1

### 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