



## デイリーシグナル

2021年7月1日(木)

### 短期市場の推移

	6月25日	6月28日	6月29日	6月30日
加重平均金利	▲0.029	▲0.030	▲0.029	▲0.050
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.083	▲0.095	▲0.082
無コール残	149,200	122,785	129,690	94,974
ON	87,764	61,779	70,094	66,688
その他	61,436	61,006	59,596	28,286
有コール残	20,903	22,491	20,672	18,664

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	▲0.070	0.001	▲0.030	▲0.082
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.003	▲0.081
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.040	▲0.008	▲0.021	▲0.082
2W	▲0.040	0.000	▲0.023	▲0.084
3W	-	-	0.050	▲0.089
1M	▲0.025	0.100	▲0.010	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.114
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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	短観 (6月調査全容)	-	21:30	(米)5月貿易収支	-709億米ドル
8:50	マネタリーベース (6月)	-	21:30	(米)6月失業率	5.7%

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▲0.025%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%の水準で合出が見られた。四半期末越えの取引を控えていた先が資金調達を再開したためレートが上昇し、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.020%の▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.035	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.060 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

調達サイドの動向は大きく変わらず、合出水準は本日対比で横ばい圏を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月1日	7月2日	7月2日	7月5日	7月5日	7月5日
券	▲900	▲400	▲400	+1,000		
財政	▲23,500	▲60,000	▲60,000	+0		
過不足	▲24,400	▲60,400	▲60,400	+1,000		
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			▲100			
社債等買入			▲200			
国債補完供給	+1,100	▲400	+400			
当座預金増減	▲23,700	▲60,300	▲60,300	+1,000		
当座預金残高	5,355,400	5,295,100	5,295,100	5,296,100		
準備預金残高	4,725,900					
積み終了先	4,725,500		法人税・消費税・			
超過準備	4,725,500		保険揚げ			
非準備先残高	629,500		国債発行(10年)			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	53.3%					
乖離率	46.6%					

### 7月1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(7/1~7/2)	397	397	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)  
6月30日時点 6,595,400

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,632,600
7月2日以降の残り所要	
積数	600
平均	0

### 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	第1006回
7月9日	3ヶ月	
7月15日	3ヶ月	

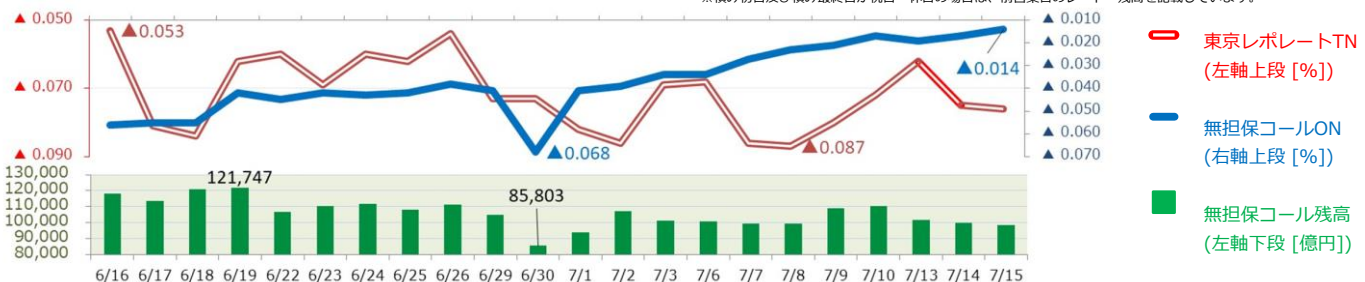
### 今月の国債買入オペ予定

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	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 14	6月2日	1
25年超	500	500		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	四半期に1回	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