



## デイリーシグナル

2021年7月8日(木)

### 短期市場の推移

	7月2日	7月5日	7月6日	7月7日
加重平均金利	▲0.027	▲0.031	▲0.032	▲0.032
東京レボレート(TN)	▲0.075	▲0.072	▲0.075	▲0.072
無コール残	122,228	111,449	112,062	113,134
ON	70,317	58,208	57,516	57,638
その他	51,911	53,241	54,546	55,496
有コール残	20,957	21,460	19,948	20,662

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	▲0.033	▲0.071
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.007	▲0.074
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.028	▲0.015	▲0.024	▲0.078
2W	▲0.040	0.000	▲0.030	▲0.080
3W	-	-	-	▲0.086
1M	▲0.018	0.120	0.029	▲0.090
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.010	▲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9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック (6月)	-	(欧)ECB総裁の講演	
	-		-	
	-		-	

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▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.020%の水準で合出が見られた。オファーサイド・ビッドサイドの動向は昨日と大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.050 ~ ▲0.025

### 翌営業日のマーケット

週末3日積みでビッドサイドの一部が調達に積極的な姿勢を見せ、出合い水準は本日対比で若干上昇すると予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月8日	7月9日	7月9日	7月12日	7月12日	7月12日
券		▲500		+200		+1,000
財政		+4,400		▲19,600		+9,000
過不足		+3,900		▲19,400		+10,000
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		+9,400				
社債等買入						+1,300
当座預金増減		+13,300		▲19,400		+11,300
当座預金残高		5,330,500		5,311,100		5,322,400
準備預金残高		4,697,300	主な需給要因			
積み終了先		4,697,300	国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(3M・6M)	
超過準備		4,697,300				
非準備先残高		633,200				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		76.7%				
乖離率		23.2%				

### 7月8日のオペ結果

7月8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
国債補完供給(7/8~7/9)	4	4	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース (億円)  
7月7日時点 6,533,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,627,900
7月9日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

7月9日	3ヶ月	第1007回
7月15日	3ヶ月	第1008回
7月19日	1年	
7月20日	6ヶ月	
7月13日	20年	
7月27日	40年	
7月29日	2年	
8月3日	10年	

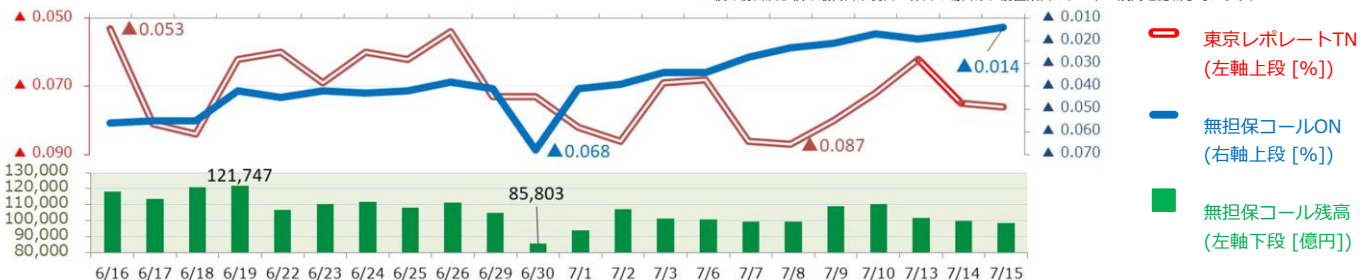
### 今月の国債買入オペ予定

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	6月23日	1
1年超3年以下	4500	4,500	2 7 14 21	7月7日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2 14 21 28	7月2日	3
5年超10年以下	4250	4,250	7 14 21 28	7月7日	3
10年超25年以下	1500	1,500	2	7月2日	0
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	四半期に1回	7月7日	0

### 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