



デイリーシグナル

2021年7月12日(月)

短期市場の推移

	7月6日	7月7日	7月8日	7月9日
加重平均金利	▲0.032	▲0.032	▲0.033	▲0.034
東京レポレート(TN)	▲0.075	▲0.072	▲0.074	▲0.075
無コール残	112,062	113,134	115,285	120,664
ON	57,516	57,638	59,439	65,068
その他	54,546	55,496	55,846	55,596
有コール残	19,948	20,662	19,530	20,184

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	▲0.035	▲0.074
T/N	▲0.025	▲0.001	▲0.006	▲0.080
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	-	-	-	▲0.081
2W	-	-	▲0.001	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	0.011	▲0.092
2M	-	-	0.001	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.115
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

7月13日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (7月10日現在)	-	EU財務相理事会 (ブリュッセル)	-
17:00頃	日本銀行が保有する 国債の銘柄別残高	-	(米)6月消費者物価 コア指数[前年比]	4.0%
17:00頃	日本銀行による国庫短期証券 の銘柄別買入額	-	-	-

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▲0.055%~▲0.020%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▲0.035%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.050 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

調運動向に大きな変化はなく、合出の水準は本日対比横ばいと予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月12日	7月13日	7月12日	7月13日	7月12日	7月13日
券	+400	+300	+400	+300	+0	+0
財政	+11,000	+4,800	+11,000	+4,800	+33,000	+33,000
過不足	+11,400	+4,500	+11,400	+4,500	+33,000	+33,000
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	▲400	▲100	▲400	▲100	-	-
社債等買入		+1,300		+1,300	-	-
国債補完供給		▲200		+200	-	-
当座預金増減	+12,100	▲4,400	+12,100	▲4,400	+33,000	+33,000
当座預金残高	5,319,700	5,315,300	5,319,700	5,315,300	5,282,300	5,282,300
準備預金残高	4,679,500	主な需給要因				
積み終了先	4,679,500	源泉税揚げ 国債発行(20年)				
超過準備	4,679,500					
非準備先残高	640,200					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	90.0%					
乖離率	10.0%					

7月12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(7/12~7/13)	
220	220 ▲0.350 ▲0.350
0	0

マネタリーベース (億円)
7月9日時点 6,524,400

所要 (億円)	
今積期の所要準備額	3,627,900
7月13日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

7月15日	3ヶ月 第1008回
7月19日	1年 第1009回
7月20日	6ヶ月
7月21日	3ヶ月

国債入札予定

7月13日	20年
7月27日	40年
7月29日	2年
8月3日	10年

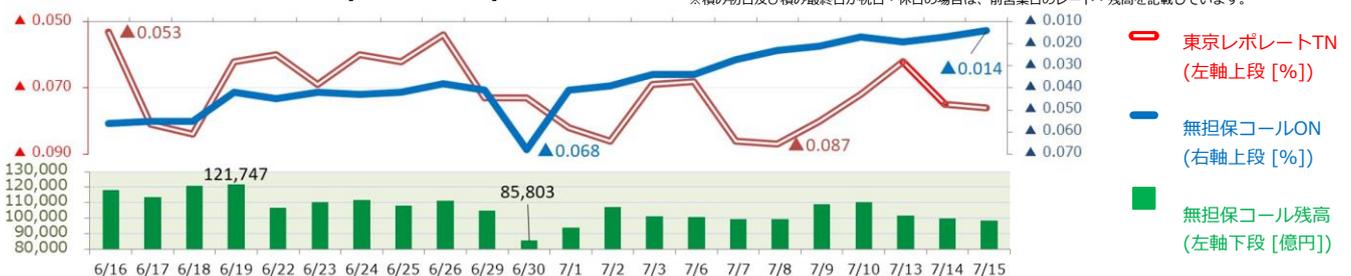
今月の国債買入オペ予定

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