



デイリーシグナル

2021年7月16日(金)

短期市場の推移

	7月12日	7月13日	7月14日	7月15日
加重平均金利	▲0.035	▲0.038	▲0.043	▲0.037
東京レポレート(TN)	▲0.080	▲0.086	▲0.100	▲0.086
無コール残	114,262	117,915	121,737	133,039
ON	60,386	63,579	67,351	81,453
その他	53,876	54,336	54,386	51,586
有コール残	20,547	19,225	19,459	20,546

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	▲0.080	0.001	▲0.035	▲0.087
T/N	-	-	▲0.001	▲0.088
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.040	▲0.007	▲0.024	▲0.087
2W	▲0.038	0.150	▲0.005	▲0.090
3W	-	-	▲0.025	▲0.092
1M	-	-	▲0.020	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
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19日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	経済・物価情勢の展望 (7月、全文)	-	-	-
-	【記者会見要旨】黒田総裁 (7月16日分)	-	-	-
-	-	-	-	-

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

新積み期となる本日の無担保コールON物は▲0.040%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲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+0.002%の▲0.035%となった。
 日本銀行は本日の金融政策決定会合にて、金融政策の現状維持を決定した。また、気候変動対応を支援するための資金供給の骨子案を公表した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

ビッドサイドに大きな動意なく、出合水準は横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月16日	7月19日	7月19日	7月20日	7月20日	7月20日
券	▲800	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+1,900	+10,800	+10,800	+16,000	+16,000	+16,000
過不足	+1,100	+9,800	+9,800	+17,000	+17,000	+17,000
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	▲500	+5,000	▲500	▲500	▲500	▲500
国債補充供給	+500	▲100	+100			
当座預金増減	+6,000	+9,400	+9,400	▲17,000	▲17,000	▲17,000
当座預金残高	5,312,700	5,322,100	5,322,100	5,305,100	5,305,100	5,305,100
準備預金残高	4,644,400	主な需給要因				
積み終了先	4,642,300	国庫短期証券	国庫短期証券	国庫短期証券	国庫短期証券	国庫短期証券
超過準備	3,397,900	発行・償還	発行・償還	発行・償還	発行・償還	発行・償還
非準備先残高	668,300	(3M)	(3M)	(1Y)	(1Y)	(1Y)
準備預金進捗率	99.8%	発行・償還	発行・償還	発行・償還	発行・償還	発行・償還
平均	9.7%	(変動15年)	(変動15年)	(変動15年)	(変動15年)	(変動15年)
乖離率	90.1%					

7月16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
国債補充供給(7/16~7/19)	84	84	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 7月15日時点 6,523,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,747,800
7月19日以降の残り所要	
積数	8,300
平均	300

国庫短期証券入札予定

7月19日	1年	第1009回
7月20日	6ヶ月	第1010回
7月21日	3ヶ月	第1011回
7月30日	3ヶ月	

国債入札予定

7月27日	40年
7月29日	2年
8月3日	10年
8月5日	物価連動

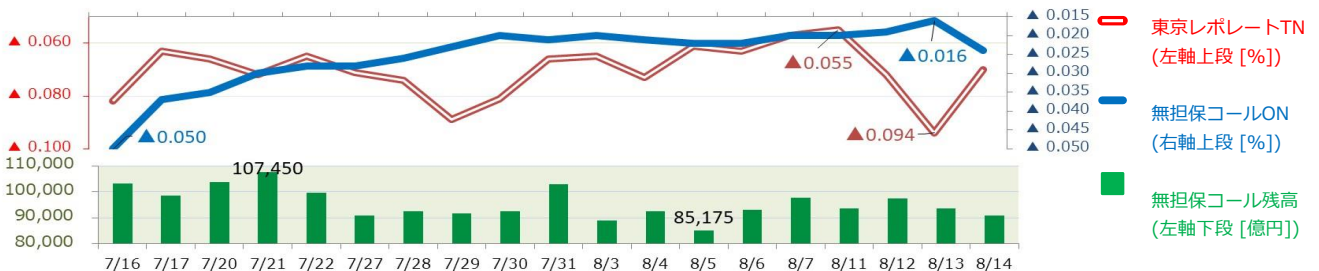
今月の国債買入オペ予定

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14日	1
3年超5年以下	4500	4,500	2 14 21 28	7月14日	2
5年超10年以下	4250	4,250	7 14 21 28	7月14日	2
10年超25年以下	1500	1,500	2	7月2日	0
25年超	500	500	14	7月14日	0
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	-

1年前の市場推移

○2020年7月積み期 [7月16日~8月14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