



デイリーシグナル

2021年7月27日(火)

短期市場の推移

	7月19日	7月20日	7月21日	7月26日
加重平均金利	▲0.035	▲0.035	▲0.038	▲0.038
東京レポレート(TN)	▲0.095	▲0.100	▲0.091	▲0.090
無コール残	137,777	143,658	154,517	142,328
ON	82,066	86,362	95,121	82,472
その他	55,711	57,296	59,396	59,856
有コール残	21,155	18,389	19,737	20,641

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	▲0.039	▲0.089
T/N	-	-	▲0.001	▲0.091
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.014	0.010	0.002	▲0.093
2W	-	-	▲0.040	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.096
1M	▲0.025	0.001	▲0.008	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.116
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28日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	金融政策決定会合における 主な意見 (7月15・16日分)	-	(米) FOMCの結果、 パウエル議長会見
	-	-	(米) 週間MBA住宅ローン 申請指数	-
	-	-	-	-

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▲0.040%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.030%の水準で合出が見られた。前日と比べ、オファーサイド・ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、同加重平均金利は前日対比▲0.001%の▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.050 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

合出の水準は横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月27日	7月28日	7月28日	7月29日	7月29日	7月29日
券	+900	+300	+300	+0	+0	+0
財政	+4,000	▲8,100	▲8,100	+4,000	+4,000	+4,000
過不足	+4,900	▲7,800	▲7,800	+4,000	+4,000	+4,000
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				+10,000		
CP等買入	▲500		▲100			
社債等買入	▲300		▲100			
国債補完供給	+600	▲200		+200		
新型コロナ対応金融支援特別	▲118,200	+132,200				
当座預金増減	+18,500	+2,200	+2,200	+4,000	+4,000	+4,000
当座預金残高	5,358,300	5,360,500	5,360,500	5,364,500	5,364,500	5,364,500
準備預金残高	4,666,900	主な需給要因				
積み終了先	4,666,600	国債発行(40年)				
超過準備	4,666,600					
非準備先残高	691,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	38.7%					
乖離率	61.2%					

7月27日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国庫短期証券買入(7/28~)	10,000	34,123	10,005	0.003	0.004	72.9
-----------------	--------	--------	--------	-------	-------	------

米ドル資金供給(7/29~8/5)	0	0	0.340	0.340		
-------------------	---	---	-------	-------	--	--

CP等買入(7/30~)	5,000	8,830	4,978	▲0.013	▲0.009	33.4
--------------	-------	-------	-------	--------	--------	------

国債補完供給(7/27~7/28)	168	168	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円) 所要 (億円)

7月26日時点	6,560,400	今積期の所要準備額	3,747,800
		7月28日以降の残り所要	
		積数	2,000
		平均	100

国庫短期証券入札予定

7月30日	3ヶ月 第1012回
8月5日	6ヶ月
8月6日	3ヶ月
8月13日	3ヶ月

国債入札予定

7月29日	2年
8月3日	10年
8月5日	物価連動
8月11日	30年

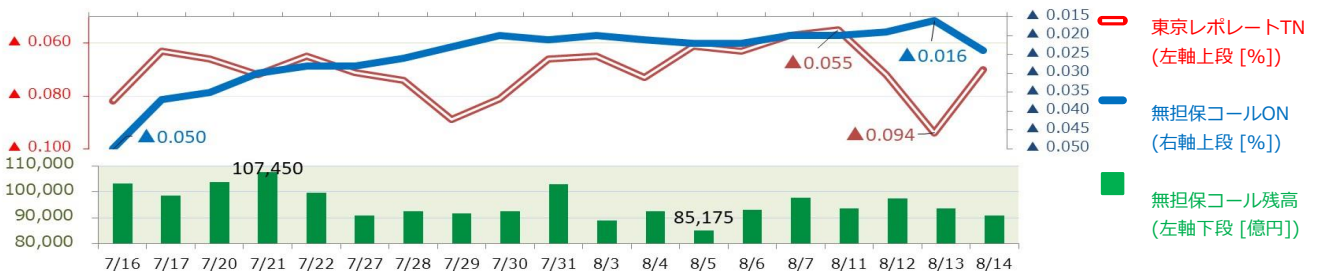
今月の国債買入オペ予定

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回程度	6月23日	1
1年超3年以下	4500	4,500	2 7 14 21	7月21日	0
3年超5年以下	4500	4,500	2 14 21 28	7月21日	1
5年超10年以下	4250	4,250	7 14 21 28	7月21日	1
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回程度	7月21日	0
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