上田八木短資

デイリーシグナル

2021年7月30日(金)

短期市場の推移 [億円] [%]

	7月26日	7月27日	7月28日	7月29日
加重平均金利	▲0.038	▲0.039	▲0.041	▲0.043
東京レポレート(TN)	▲0.090	▲0.091	▲0.088	▲0.087
無コール残	142,328	140,200	137,520	137,024
ON	82,472	79,924	76,144	76,278
その他	59,856	60,276	61,376	60,746
有コール残	20,641	20,094	20,923	19,534

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。

8月2日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		23:00	(米)7月ISM製造業景況指数	60.7
	-			-	
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.150	0.001	▲0.044	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.089
2W	▲0.040	▲0.020	▲0.037	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.094
1M	▲0.030	▲0.010	▲0.021	▲0.098
2M	-	-	▲0.005	-
3M	-	-	▲0.028	▲0.104
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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%～▲0.040%の水準で出合が見られた。月末につき地銀業態の一部が資金調達を控えたため、同加重平均金利は前日対比▲0.001%の▲0.044%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.080 ～ ▲ 0.070	▲ 0.060 ～ ▲ 0.060	▲ 0.080 ～ ▲ 0.030

翌営業日のマーケット

資金調達ニーズに大きな変化はなく、出合いの水準は横ばい圏を予想する。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月30日		8月2日		8月3日	
券	+300		+800		+0	
財政	+15,100		▲14,800		▲2,000	
過不足	+15,400		▲14,000		▲2,000	
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	▲3,900	+5,000	▲200			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+100					
当座預金増減	+16,500		▲14,200		▲2,000	
当座預金残高	5,388,800		5,374,600		5,372,600	
準備預金残高	4,691,600		主な需給要因			
積み終了先	4,691,200		国庫短期証券			
超過準備	4,691,200		発行・償還(3M)			
非準預先残高	697,200		国債発行・償還(2Y)			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	54.8%					
乖離率	45.1%					

7月30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(7/30～8/2)						
	22	22	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

7月29日時点	6,592,500

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,747,800
8月2日以降の残り所要	
積数	300
平均	0

国庫短期証券入札予定

8月5日	6ヶ月　第1013回
8月6日	3ヶ月　第1014回
8月13日	3ヶ月
8月19日	1年

国債入札予定

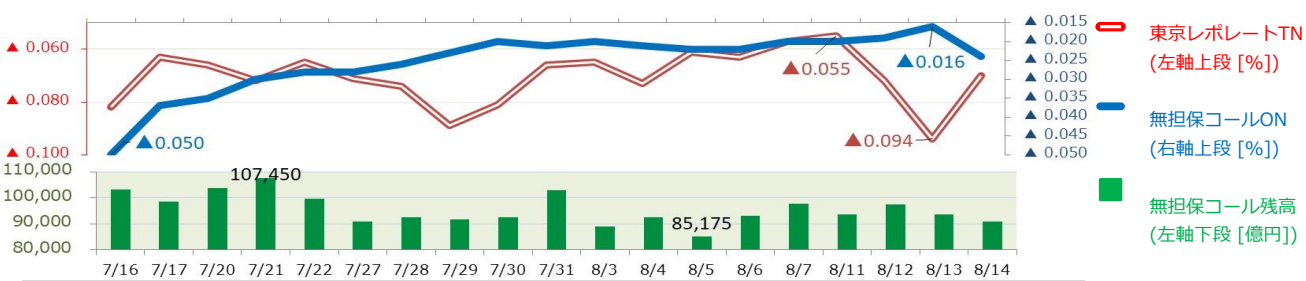
8月3日	10年
8月5日	物価連動
8月11日	30年
8月24日	5年

来月の国債買入オペ予定 [億円]

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						7月28日	1
1年超3年以下	4500	4,500	4	12	18	25			7月21日	4
3年超5年以下	4500	4,500	4	12	18	30			7月28日	4
5年超10年以下	4250	4,250	12	18	25	30			7月28日	4
10年超25年以下	1500	1,500	4						7月2日	1
25年超	500	500	25						7月14日	1
物価連動債	600	600	月1回						7月21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