



デイリーシグナル

2021年8月5日(木)

短期市場の推移

	7月30日	8月2日	8月3日	8月4日
加重平均金利	▲0.044	▲0.043	▲0.041	▲0.039
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.085	▲0.085
無コール残	138,396	136,620	127,250	122,497
ON	79,515	75,579	64,149	61,466
その他	58,881	61,041	63,101	61,031
有コール残	20,785	19,339	19,719	20,312

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	▲0.030	▲0.079
T/N	-	-	▲0.020	▲0.081
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.055	▲0.030	▲0.051	▲0.084
2W	-	-	▲0.028	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.093
1M	0.070	0.150	0.137	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.130

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

8月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米)7月失業率
-	-	-	5.7%
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.020%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%の水準で合出が見られた。地銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、同加重平均金利は前日対比+0.009%の▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.040	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.055 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

週末4日積みであることから資金調達ニーズが強くなることが予想され、出合いの水準は上昇する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月5日	8月6日	8月6日	8月10日	8月10日	8月10日
券	▲400		+300		▲1,000	
財政	+1,400		+1,300		+1,000	
過不足		+1,000	+1,600		+0	
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		+10,700				
CP等買入			▲300			
当座預金増減		+11,700	+1,300		+0	
当座預金残高		5,292,900	5,294,200		5,294,200	
準備預金残高		4,638,800			主な需給要因	
積み終了先		4,638,800			物価運動債発行	
超過準備		4,638,800			(10年)	
非準備先残高		654,100			国庫短期証券	
準備預金進捗率		99.9%			発行・償還	
平均		67.7%			(3M・6M)	
乖離率		32.2%				

8月5日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

社債等買入(8/11~)	1,250	2,587	1,251	▲0.050	▲0.034	26.5
国債補完供給(8/5~8/6)	33	33	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
8月4日時点 6,500,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,747,800
8月6日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

8月6日	3ヶ月 第1014回
8月13日	3ヶ月
8月19日	1年
8月20日	3ヶ月

国債入札予定

8月11日	30年
8月24日	5年
8月26日	20年
8月31日	2年

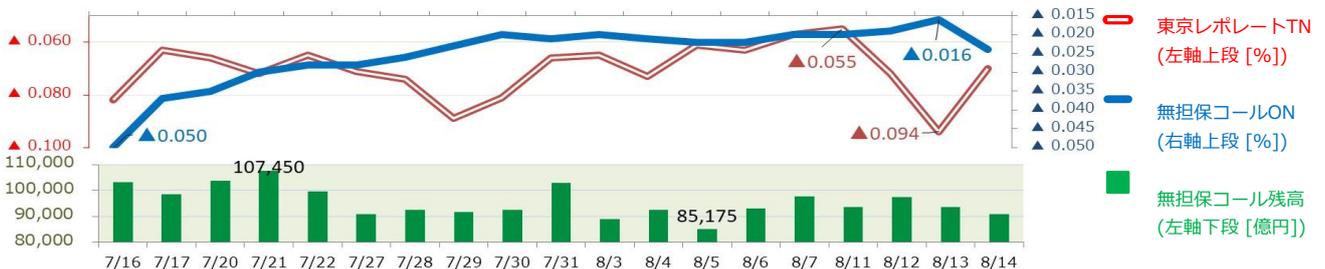
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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	8月4日	3
3年超5年以下	4500	4,500	4 12 18 30	8月4日	3
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	8月4日	0
25年超	500	500	25	7月14日	1
物価運動債	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ありません。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