上田八木短資

デイリーシグナル

2024年7月1日(月)

短期市場の推移 [億円] [%]

	6月25日	6月26日	6月27日	6月28日
加重平均金利	0.078	0.077	0.077	0.076
東京レポレート(TN)	0.084	0.052	▲0.061	0.047
無コール残	81,627	79,744	79,177	79,425
ON	35,168	33,545	33,908	39,831
その他	46,459	46,199	45,269	39,594
有コール残	37,581	37,680	37,508	36,121

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。

7月2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀短観（調査全容・6月）		（欧）消費者物価（速報）（6月）	
	-		-	
	-		-	

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	0.079	0.077	0.076
T/N	-	-	-	0.061
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.053
2W	0.110	0.300	0.160	0.051
3W	-	-	-	0.051
1M	0.135	0.210	0.181	0.051
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.084
6M	-	-	-	0.139
1Y	-	-	-	0.200

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

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後は主に0.075%～0.078%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、ON物加重平均金利（速報）は前営業日対比0.001%上昇の0.077%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ～ -	- ～ -	0.075 ～ 0.078

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは旺盛であり、出合の水準は本日対比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1日		7月2日		7月3日	
券	+500		+1,000		+0	
財政	▲4,300		▲12,600		▲50,000	
過不足	▲3,800		▲11,600		▲50,000	
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
国債買入		+6,700				
国債補完供給	+25,400	▲26,500	+26,500			
当座預金増減	+1,800		+14,900		▲50,000	
当座預金残高	5,519,600		5,534,500		5,484,500	
準備預金残高	4,928,600		主な需給要因			
積み終了先	4,928,500				法人税・消費税・保険揚げ	
超過準備	4,928,500				国債発行（10年）	
非準預先残高	591,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	53.3%					
乖離率	46.6%					

国債補完供給(7/1～7/2)
27,132 27,132 ▲0.250 ▲0.250
0 0

7月1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

マネタリーベース [億円]

6月28日時点	6,753,900

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,942,000
7月2日以降の残り所要	
積数	600
平均	0

国庫短期証券入札予定

7月5日	3ヶ月(第1241回)
7月9日	6ヶ月
7月12日	3ヶ月
7月18日	1年

国債入札予定

7月2日	10年
7月4日	30年
7月9日	5年
7月11日	20年

今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						6月7日	1
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	3	10	17	23			6月24日	4
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	3	10	23	29			6月28日	4
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	10	17	23	29			6月24日	4
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	3	17	29				6月28日	3
25年超	500~1,000	750	10	29					6月28日	2
物価連動債	600	600	月1回						6月28日	1
変動利付債	-	300	-						4月14日	-

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