

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月3日(水)

## 短期市場の推移

	5月28日	5月29日	6月1日	6月2日
加重平均金利	▲0.057	▲0.073	▲0.058	▲0.059
東京レポレート(ON)	▲0.110	▲0.106	▲0.097	▲0.098
無コール残	124,026	120,286	129,682	130,723
ON	75,327	75,002	82,478	80,959
その他	48,699	45,284	47,204	49,764
有コール残	18,032	17,640	20,360	19,118

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。

## 6月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(欧)6月欧中銀(ECB)政策金利	0%
-	-	(米)4月貿易収支	-415億米ドル
-	-	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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	▲0.087	0.001	▲0.068	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.001	▲0.003	▲0.101
2W	-	-	-	▲0.103
3W	-	-	▲0.025	▲0.105
1M	-	-	-	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.164
1Y	-	-	-	▲0.188

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▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.055%の水準で出合が見られた。本日は大手行の一部が調達を控えたため、昨日と比べ、地合は軟調となり、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.009%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	-	▲0.080 ~ ▲0.040

## 翌営業日のマーケット

引き続き大手行の出合が中心となり、出合水準は本日対比横ばいと予想する。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月3日	6月4日	6月4日	6月5日	6月5日	6月6日
券		+100		▲600		+0
財政		▲44,700		+2,600		▲6,000
過不足		▲44,600		+2,000		▲6,000
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		+30,000				
国債買入				+6,500		
CP等買入	▲300					
社債等買入	▲100		▲100			
ETF買入		+100				
国債補完供給	+400	▲200	+200			
米ドル資金供給用担保国債供給		▲1,000				
成長基盤強化支援	▲4,500	+2,000				
当座預金増減		▲18,200		+8,600		▲6,000
当座預金残高		4,164,600		4,173,200		4,167,200
準備預金残高		3,595,600				
積み終了先		3,595,200				
超過準備		3,595,200				
非準預先残高		569,000				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		61.3%				
乖離率		38.6%				

## 6月3日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(6/4~)						
~1年	800	2,125	805	0.005	0.006	75.2
3~5年	3,200	8,118	3,206	0.007	0.008	37.6
10~25年	1,200	4,142	1,210	0.007	0.008	44.4
変動利付	1,000	1,997	1,005	▲0.280	▲0.295	38.7
米ドル資金供給(6/5~6/12)						
0			0	0.300	0.300	
国債補完供給(6/3~6/4)						
214		214	▲0.350	▲0.350		
0		0				

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月2日時点 5,346,700	今積期の所要準備額 3,360,900
	6月4日以降の残り所要積数 2,700
	平均 200

## 国庫短期証券入札予定

6月5日	3ヶ月	第912回
6月9日	6ヶ月	第913回
6月12日	3ヶ月	
6月15日	6ヶ月	
6月4日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月30日	2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	500~1,000	800	月3回程度	6月3日	2
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	1 5 12 17 22 26	6月1日	5
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月3日	5
5年超10年以下	2,500~5,500	3,700	5 10 17 22 29	5月29日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	3 29	6月3日	1
25年超	0~500	300	1 17	6月1日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	6月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	1回	6月3日	0

## 1年前の市場推移

○2019年5月積み期 [5月16日~6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。