

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月4日(木)

短期市場の推移

	5月29日	6月1日	6月2日	6月3日
加重平均金利	▲0.073	▲0.058	▲0.059	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.106	▲0.097	▲0.098	▲0.097
無コール残	120,286	129,682	130,723	127,334
ON	75,002	82,478	80,959	78,270
その他	45,284	47,204	49,764	49,064
有コール残	17,640	20,360	19,118	18,750

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00	景気動向 指数速報(4月)	21:30	(米)5月非農業 部門雇用者数 -800万人
15:00	コール市場残高(5月)	-	21:30 (米)5月失業率 19.5%

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	▲0.080	0.001	▲0.064	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.097
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.070	▲0.097
2W	▲0.025	▲0.020	▲0.023	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.104
1M	-	-	-	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
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▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.055%の水準で出合が見られた。昨日よりも大手行の調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.004%の▲0.064%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.065	-	▲0.075 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

週末3日積みのため、本日対比で出合水準が若干上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月4日		6月5日		6月8日	
券	▲500		+100		+1,000	
財政	+900		+100		▲44,000	
過不足	+400		+200		▲43,000	
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	+6,500		▲300			
CP等買入						
社債等買入	▲100					
ETF買入			+1,000			
国債補完供給	+200	▲500	+500			
当座預金増減	+6,500		+1,400		▲43,000	
当座預金残高	4,171,100		4,172,500		4,129,500	
準備預金残高	3,590,900		3,590,900		主な需給要因	
積み終了先	3,590,500					
超過準備	3,590,500					
非準備先残高	580,200		国債発行(30年)		国庫短期証券発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.9%					
平均	64.5%					
乖離率	35.4%					

6月4日のオペ結果 [元] [米ドル]

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
米ドル資金供給(6/8~6/15)						
		0	0	0.310	0.310	
CP等買入(6/9~)	6,000	13,780	6,000	▲0.017	▲0.005	3.9
国債補完供給(6/4~6/5)		507	507	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]
6月3日時点 5,328,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,360,900
6月5日以降の残り所要
積数 2,300
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18日	5年	
6月25日	20年	
6月30日	2年	
7月2日	10年	

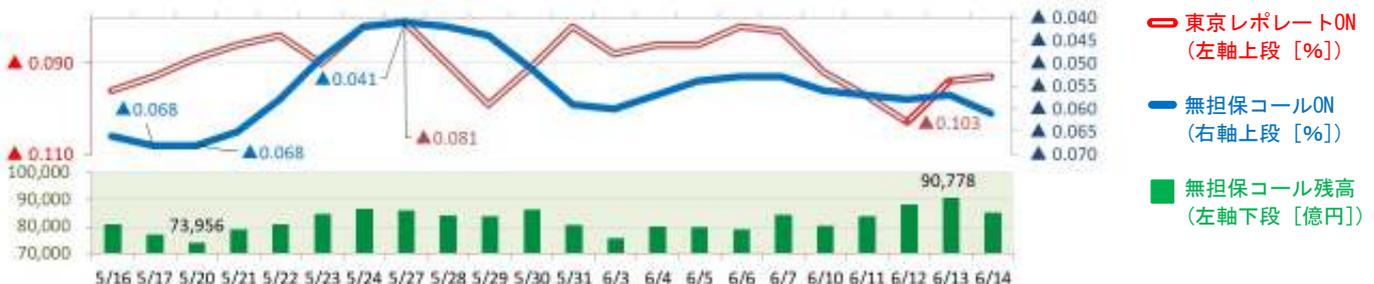
今月の国債買入オペ予定

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。