

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月5日(金)

短期市場の推移

	6月1日	6月2日	6月3日	6月4日
加重平均金利	▲0.058	▲0.059	▲0.068	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.098	▲0.097	▲0.098
無コール残	129,682	130,723	127,334	136,031
ON	82,478	80,959	78,270	84,067
その他	47,204	49,764	49,064	51,964
有コール残	20,360	19,118	18,750	21,079

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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	1-3月期国内総生産 (GDP)改定値 [前期比年率]	▲2.1%	15:00	(独)4月鉱工業生産指数 [前月比]	-15.5%
8:50	4月国際収支(経常収支)	4899億円		-	
8:50	国際収支状況(4月速報)	-		-	

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	▲0.057	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.091
2W	-	-	-	▲0.095
3W	-	-	-	▲0.101
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▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.07%~▲0.05%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.057%となった。なお、6月4日の無担保コール市場残高は2020年3月以来、約3か月ぶりの13兆6,000億円台となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.055	▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.087 ~ ▲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、出合水準は横ばい圏の見込み。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月5日	6月8日	6月9日
券	+100	+300	+0
財政	▲2,200	▲39,400	+11,000
過不足	▲2,100	▲39,100	+11,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		▲10,900	
CP等買入	▲300	▲200	+6,000
ETF買入	+1,000		
国債補完供給	+500	+300	
当座預金増減	▲1,200	▲28,100	+17,000
当座預金残高	4,169,900	4,141,800	4,158,800
準備預金残高	3,583,700	主な需給要因	
積み終了先	3,583,500		
超過準備	3,583,400		
非準備預金残高	586,200	国庫短期証券	
準備預金進捗率	99.9%	発行・償還(3M)	
平均	74.2%		
乖離率	25.7%		

6月5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(6/8~)						
1~3年	3,400	13,308	3,403	0.008	0.009	40.5
3~5年	3,200	8,963	3,203	0.009	0.009	90.1
5~10年	4,000	7,133	4,011	0.006	0.008	20.8
米ドル資金供給(6/9~6/16)						
			0	0	0.320	0.320
国債補完供給(6/5~6/8)						
			272	272	▲0.350	▲0.350
			0	0		

マナタリーベース	所要
6月4日時点 5,335,400	今積期の所要準備額 3,399,300
	6月8日以降の残り所要積数 1,600
	平均 200

国庫短期証券入札予定

6月9日	6ヶ月	第913回
6月12日	3ヶ月	第914回
6月15日	6ヶ月	
6月18日	1年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月30日	2年	
7月2日	10年	

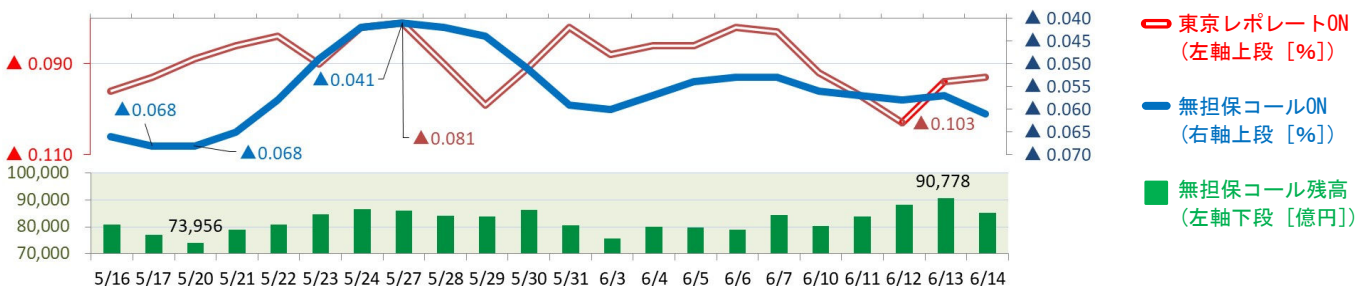
今月の国債買入オペ予定

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5日	4
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月5日	4
5年超10年以下	2,500~5,500	4,000	5 10 17 22 29	6月5日	4
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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会