

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月11日(木)

短期市場の推移

	6月5日	6月8日	6月9日	6月10日
加重平均金利	▲0.057	▲0.055	▲0.048	▲0.038
東京レポレート(ON)	▲0.094	▲0.084	▲0.064	▲0.059
無コール残	135,147	124,046	121,033	113,058
ON	84,513	74,032	71,014	65,544
その他	50,634	50,014	50,019	47,514
有コール残	18,642	18,437	19,044	19,525

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12日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告(6月10日現在)	-	23:00	(米)6月ミシガン大学消費者信頼感指数速報 75.0
	-			-
	-			-

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	▲0.070	0.001	▲0.031	▲0.048
T/N	-	-	▲0.050	▲0.072
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.001	▲0.003	▲0.074
2W	-	-	-	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.093
1M	-	-	-	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.120
6M	-	-	-	▲0.163
1Y	-	-	-	▲0.187

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▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.020%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▲0.031%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.030		▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.045 ~ ▲0.020

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11日	6月12日	6月11日	6月12日	6月15日
券	▲1,200	▲1,000			+0
財政	+1,800	▲2,400			+26,000
過不足	+600	▲3,400			+26,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+8,200		+30,000	
国債買入					▲4,000
共通担保(全店)					
CP等買入	▲600		▲700		
社債等買入			▲700		+3,000
ETF買入		+1,000		+100	
被災地金融機関支援			▲900	+500	
国債補完供給	+600	▲500	+500		
米ドル資金供給用担保国債供給			+9,500		
当座預金増減	+9,300		+34,900		+25,000
当座預金残高	4,166,100		4,201,000		4,226,000
準備預金残高	3,600,000				
積み終了先	3,599,800				
超過準備	3,599,800				
非準預先残高	566,100				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	87.1%				
乖離率	12.8%				

6月11日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 接分

国庫短期証券買入(6/12~)	30,000	45,568	30,003	▲0.002	0.004	60.7
米ドル資金供給(6/15~6/22)	0	0	0	0.330	0.330	

米ドル資金供給(6/15~6/22)

国債補完供給(6/11~6/12)	481	481	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
6月10日時点 5,321,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,399,300
6月12日以降の残り所要積数	800
平均	200

国庫短期証券入札予定

6月12日	3ヶ月	第914回
6月15日	6ヶ月	第915回
6月18日	1年	第916回
6月19日	3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	

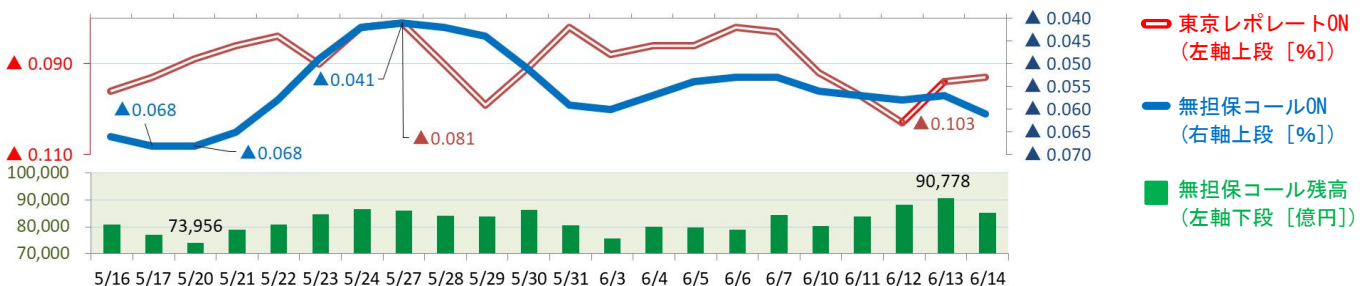
今月の国債買入オペ予定

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10日	1
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	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10日	3
5年超10年以下	2,500~5,500	4,000	5 10 17 22 29	6月10日	3
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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会