

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月17日(水)

## 短期市場の推移

	6月11日	6月12日	6月15日	6月16日
加重平均金利	▲0.031	▲0.023	▲0.018	▲0.056
東京レポレート(ON)	▲0.048	▲0.059	▲0.093	▲0.054
無コール残	111,675	119,805	109,963	118,004
ON	63,311	70,796	64,284	69,675
その他	48,364	49,009	45,679	48,329
有コール残	18,427	18,853	19,033	19,381

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18日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
6月の月例経済報告		21:30 (米)6月フィラデルフィア連銀製造業景況指数	-27.5
-		21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-		23:00 (米)5月景気先行指数	2.4%

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	▲0.055	▲0.069
T/N	-	-	-	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.080	0.040	▲0.052	▲0.082
2W	-	-	-	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.093
1M	-	-	-	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.120
6M	-	-	-	▲0.165
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▲0.060%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.050%のレンジで出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.055%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.055	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.050

## 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17日	6月18日	6月17日	6月18日	6月19日	6月19日
券	▲1,100	▲2,200		▲1,000		▲1,000
財政	▲200	+4,100		▲23,000		▲23,000
過不足	▲1,300	+1,900		▲24,000		▲24,000
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				+7,800		
CP等買入	▲300	+6,000	▲400			
ETF買入		+200				
国債補完供給	+600	▲300	+300			
米ドル資金供給用担保国債供給	▲23,700			+84,500		+63,200
貸出増加支援				▲62,000		
当座預金増減	▲18,800	+39,600		+61,700		
当座預金残高	4,183,400	4,223,000		4,284,700		
準備預金残高	3,605,900					
積み終了先	3,494,200					
超過準備	3,034,600					
非準備預金残高	577,500					
準備預金進捗率	97.2%					
平均	6.7%					
乖離率	90.6%					

## 6月17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	接分
国庫短期証券買入(6/18~)	30,000	62,748	30,002	0.003	0.006	20.8
国債買入(6/18~)						
1~3年	3,400	11,762	3,401	0.002	0.003	70.8
5~10年	4,000	8,202	4,005	▲0.003	▲0.003	90.4
25年~	300	1,287	304	0.011	0.012	23.9
米ドル資金供給(6/19~6/26)	0	0	0	0.340	0.340	
国債補完供給(6/17~6/18)	321	321	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
6月16日時点 5,369,100

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,320,800  
6月18日以降の残り所要積数 92,000  
平均 3.300

## 国庫短期証券入札予定

6月18日	1年	第916回
6月19日	3ヶ月	第917回
6月26日	3ヶ月	
7月3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	1 5 12 17 22 26	6月17日	2
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月12日	2
5年超10年以下	2,500~5,500	4,000	5 10 17 22 29	6月17日	2
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17日	0
物価連動債	300	300	月2回程度	6月12日	0
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6月積み期 [6月14日~7月12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