

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月19日(金)

## 短期市場の推移 [億円] [%]

	6月15日	6月16日	6月17日	6月18日
加重平均金利	▲0.018	▲0.056	▲0.055	▲0.055
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.054	▲0.069	▲0.079
無コール残	109,963	118,004	113,724	120,727
ON	64,284	69,675	64,140	71,353
その他	45,679	48,329	49,584	49,374
有コール残	19,033	19,381	19,834	19,361

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22日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)5月中古住宅販売件数	423万件
-	-	(米)5月シカゴ連銀全米活動指数	-
-	-	-	-

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	▲0.042	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.062
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.035	▲0.048	▲0.073
2W	-	-	0.500	▲0.084
3W	-	-	0.100	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.117
6M	-	-	-	▲0.165
1Y	-	-	-	▲0.189

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.040%のレンジで出合が見られた。3日積みということもあり、大手行を中心に調達ニーズが強く、地合は強含み、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.013%の▲0.042%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.040	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.060 ~ ▲0.050

## 翌営業日のマーケット

大手行の出合が中心となり、引き続き堅調な地合が継続すると予想。

## 資金需給 [億円]

	日銀速報 6月19日	日銀予想 6月22日	当社需給予想 6月23日
券	▲1,200	▲800	▲1,000
財政	▲17,800	+75,700	+4,000
過不足	▲19,000	+74,900	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲700	▲100	-
社債等買入	▲800	-	-
ETF買入	+100	-	-
国債補完供給	+400	+100	-
米ドル資金供給用担保国債供給	+85,800	-	-
貸出増加支援	▲49,100	+63,200	-
当座預金増減	+79,800	+74,900	+3,000
当座預金残高	4,301,500	4,376,400	4,379,400
準備預金残高	3,709,500	主な需給要因	
積み終了先	3,706,100	-	-
超過準備	3,701,900	国債償還(5年・10年・20年)	-
非準備先残高	592,000	国庫短期証券	-
準備預金進捗率	99.6%	発行・償還(3M)	-
平均	20.0%	-	-
乖離率	79.6%	-	-

## 6月19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
米ドル資金供給(6/23~6/30)	0	0	0.340	0.340	-	-
国債補完供給(6/19~6/22)	55	55	▲0.350	▲0.350	-	-
	0	0	-	-	-	-

マナタリーベース [億円]  
6月18日時点 5,391,900

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,320,800  
6月22日以降の残り所要積数 14,800  
平均 600

## 国庫短期証券入札予定

6月26日	3ヶ月	第918回
7月3日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月10日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月25日	20年	
6月30日	2年	
7月2日	10年	
7月7日	30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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会