

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月23日(火)

## 短期市場の推移

	6月17日	6月18日	6月19日	6月22日
加重平均金利	▲0.055	▲0.055	▲0.042	▲0.045
東京レポレート(ON)	▲0.069	▲0.079	▲0.088	▲0.069
無コール残	113,724	120,727	121,747	127,398
ON	64,140	71,353	71,873	61,544
その他	49,584	49,374	49,874	45,364
有コール残	19,834	19,361	19,824	20,490

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24日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合における 主な意見(6月15・16日分)	-	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.060
T/N	-	-	-	▲0.069
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	▲0.040	▲0.059	▲0.079
2W	-	-	-	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
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▲0.065%~▲0.035%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+0.003%の▲0.042%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.065 ~ ▲0.035

## 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏と予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月23日	6月24日	6月24日	6月25日	6月25日	6月26日
券	▲1,500	▲1,600	▲1,600	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+600	+400	+400	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	▲900	▲1,200	▲1,200	+2,000	+2,000	+2,000
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		+10,800		+30,000		+30,000
国債買入						
CP等買入	▲500		▲500			
ETF買入		+300				
国債補完供給	+100					
米ドル資金供給用担保国債供給			▲28,200			
新型コロナ対応金融支援特別				▲34,000		
当座預金増減	+9,800	+100	+100	▲32,000	▲32,000	▲32,000
当座預金残高	4,385,400	4,385,500	4,385,500	4,353,500	4,353,500	4,353,500
準備預金残高	3,774,600	3,773,000	3,773,000	3,773,000	3,773,000	3,773,000
積み終了先	3,773,000	3,773,000	3,773,000	3,773,000	3,773,000	3,773,000
超過準備	3,773,000	3,773,000	3,773,000	3,773,000	3,773,000	3,773,000
非準備先残高	610,800	610,800	610,800	610,800	610,800	610,800
準備預金進捗率	99.7%	99.7%	99.7%	99.7%	99.7%	99.7%
平均	26.7%	26.7%	26.7%	26.7%	26.7%	26.7%
乖離率	73.0%	73.0%	73.0%	73.0%	73.0%	73.0%

## 6月23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(6/24~)	30,000	88,909	30,003	0.003	0.005	0.6
米ドル資金供給(6/25~7/2)	21,303	21,303	21,303	0.340	0.340	
米ドル資金供給(6/25~9/17)	16,016	16,016	16,016	0.320	0.320	
社債等買入(6/29~)	2,000	6,177	2,000	0.170	0.192	33.3
国債補完供給(6/23~6/24)	38	38	38	▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(6/24~7/3)	25,000	12,413	12,413	▲0.100	▲0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(6/24~9/18)	20,000	15,135	15,135	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]  
6月22日時点 5,547,900

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,320,800  
6月24日以降の残り所要積数 10,400  
平均 500

## 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22日	1
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月22日	1
5年超10年以下	2,500~5,500	4,000	5 10 17 22 29	6月22日	1
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。