

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月25日(木)

## 短期市場の推移

	6月19日	6月22日	6月23日	6月24日
加重平均金利	▲0.042	▲0.045	▲0.042	▲0.043
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.069	▲0.060	▲0.061
無コール残	121,747	106,908	110,645	111,690
ON	71,873	61,544	63,806	65,101
その他	49,874	45,364	46,839	46,589
有コール残	19,824	20,490	20,822	19,890

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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)5月個人消費支出	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.063
T/N	-	-	-	▲0.062
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.001	▲0.073
2W	-	-	0.003	▲0.079
3W	-	-	-	▲0.085
1M	-	-	0.480	▲0.093
2M	-	-	0.050	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.164
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。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.042%となった。また本日の日銀当座預金は過去最高の443.7兆円(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.042	▲0.060 ~ ▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.040

## 翌営業日のマーケット

週末3日積となるため出合の水準は本日対比で上昇すると予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月25日	6月26日	6月25日	6月26日	6月29日
券	▲2,900	▲1,500	-	-	+0
財政	+8,800	▲4,500	-	-	▲44,000
過不足	+5,900	▲6,000	-	-	▲44,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	-	-	-	-	▲2,300
CP等買入	▲700	-	▲1,200	-	-
社債等買入	▲500	-	-	-	+2,000
国債補完供給	▲100	+100	-	-	-
米ドル資金供給用担保国債供給	-	+44,200	-	-	-
新型コロナ対応金融支援特別	▲34,000	+82,800	-	-	-
当座預金増減	+53,400	+37,100	-	-	▲44,300
当座預金残高	4,437,000	4,474,100	-	-	4,429,800
準備預金残高	3,820,200	-	-	-	-
積み終了先	3,818,100	-	-	-	-
超過準備	3,818,000	-	-	-	-
非準備先残高	616,800	-	-	-	-
準備預金進捗率	99.8%	-	-	-	-
平均	33.3%	-	-	-	-
乖離率	66.5%	-	-	-	-

## 6月25日のオペ結果

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(6/29~7/6)	-	200	200	0.330	0.330	-
CP等買入(6/30~)	6,000	13,394	5,981	▲0.003	0.000	40.2
国債補完供給(6/25~6/26)	94	94	▲0.350	▲0.350	-	-
	0	0	-	-	-	-

マナタリーベース [億円]  
6月24日時点 5,559,100

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,320,800  
6月26日以降の残り所要積数 7,100  
平均 400

## 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	
6月30日	2年	
7月2日	10年	
7月7日	30年	
7月9日	5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