

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月26日(金)

短期市場の推移

	6月22日	6月23日	6月24日	6月25日
加重平均金利	▲0.045	▲0.042	▲0.043	▲0.042
東京レポレート(ON)	▲0.069	▲0.060	▲0.061	▲0.063
無コール残	106,908	110,645	111,690	108,096
ON	61,544	63,806	65,101	61,827
その他	45,364	46,839	46,589	46,269
有コール残	20,490	20,822	19,890	20,225

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29日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	ユーロ圏景況感指数(6月)	-
-	-	ユーロ圏消費者信頼感指数(6月)	-
-	-	-	-

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	▲0.038	▲0.058
T/N	-	-	-	▲0.054
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.071
2W	-	-	-	▲0.077
3W	-	-	-	▲0.081
1M	-	-	-	▲0.091
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▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.030%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+0.004%の▲0.038%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.035	▲0.070 ~ ▲0.035	▲0.055 ~ ▲0.035

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 6月26日	日銀予想 6月29日	当社需給予想 6月30日
券	▲1,600	▲1,200	+500
財政	▲4,800	▲37,400	+20,300
過不足	▲6,400	▲38,600	+20,800
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	-	-	+6,700
共通担保(全店)	-	▲2,300	+1,900
CP等買入	▲1,200	▲200	-
社債等買入	-	-	+2,000
国債補完供給	+100	▲100	+100
米ドル資金供給用担保国債供給	+44,200	-	-
当座預金増減	+36,600	▲30,400	+26,800
当座預金残高	4,473,600	4,443,200	4,470,000
準備預金残高	3,869,700	主な需給要因	
積み終了先	3,869,100	国庫短期証券 発行・償還(3M)	
超過準備	3,868,300	-	
非準備預金残高	603,900	-	
準備預金進捗率	99.9%	-	
平均	43.3%	-	
乖離率	56.6%	-	

6月26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
国債買入(6/29~)						
1~3年	3,400	10,053	3,412	0.006	0.006	59.4
3~5年	3,200	7,795	3,201	▲0.003	▲0.001	20.2
米ドル資金供給(6/30~7/7)						
90		90	0.330	0.330		
国債補完供給(6/26~6/29)						
129		129	▲0.350	▲0.350		
0		0				
共通担保(全店)(6/29~7/13)						
20,000		1,900	1,900			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月25日時点 5,615,400	今積期の所要準備額 3,320,800
	6月29日以降の残り所要積数 2,800
	平均 200

国庫短期証券入札予定

7月3日	3ヶ月	第919回
7月9日	6ヶ月	
7月10日	3ヶ月	
7月16日	1年	
6月30日	2年	
7月2日	10年	
7月7日	30年	
7月9日	5年	

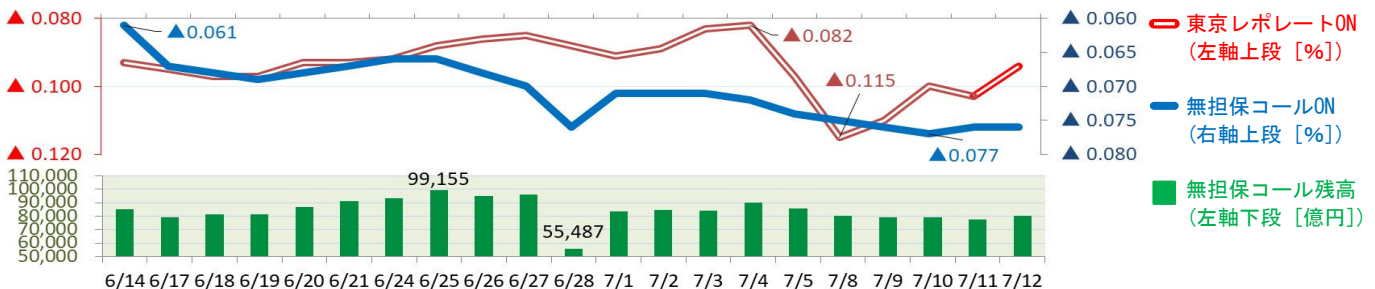
今月の国債買入オペ予定

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26日	0
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月26日	0
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。 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