

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月29日(月)

短期市場の推移

	6月23日	6月24日	6月25日	6月26日
加重平均金利	▲0.042	▲0.043	▲0.042	▲0.038
東京レポレート(ON)	▲0.060	▲0.061	▲0.063	▲0.058
無コール残	110,645	111,690	108,096	111,168
ON	63,806	65,101	61,827	66,389
その他	46,839	46,589	46,269	44,779
有コール残	20,822	19,890	20,225	20,695

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30日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	完全失業率(5月)		(米)消費者信頼感指数(6月)	
14:00	住宅着工件数(5月)		(米)NY連銀総裁の講演	
			(米)米財務長官とパウエルFRB議長が議会証言	

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	▲0.087	0.001	▲0.041	▲0.060
T/N	▲0.150	▲0.080	▲0.117	▲0.073
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.063	0.000	▲0.031	▲0.070
2W	-	-	▲0.055	▲0.074
3W	-	-	-	▲0.078
1M	-	-	0.000	▲0.086
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.107
6M	-	-	-	▲0.164
1Y	-	-	-	▲0.188

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%~▲0.035%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▲0.041%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.040		▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

四半期末初物となる明日は、調達を控える先が見られ、出合水準は低下すると予想。

資金需給

	日銀速報 6月29日	日銀予想 6月30日	当社需給予想 7月1日
券	▲1,200	▲900	+0
財政	▲32,000	+17,400	▲22,000
過不足	▲33,200	+16,500	▲22,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+6,700	+6,400	スタート
共通担保(全店)	▲2,300	+1,900	
CP等買入	▲200	▲5,800	+6,000
社債等買入	+2,000		
ETF買入		+1,100	
国債補完供給	+100	+100	
当座預金増減	▲25,100	+24,300	▲22,000
当座預金残高	4,448,500	4,472,800	4,450,800
準備預金残高	3,849,800	主な需給要因	
積み終了先	3,849,500		
超過準備	3,849,400		
非準備先残高	598,700		
準備預金進捗率	99.9%		国債発行・償還(2年)
平均	46.7%		
乖離率	53.2%		

6月29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(6/30~)						
~1年	800	2,039	802	0.004	0.009	60.0
5~10年	4,000	10,122	4,011	0.001	0.002	35.2
10~25年	1,200	4,727	1,222	0.003	0.003	42.4
米ドル資金供給(7/1~7/8)			93	93	0.330	0.330
国債補完供給(6/29~6/30)			53	53	▲0.350	▲0.350
			0	0		

マナタリーベース [億円]
6月26日時点 5,653,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,320,800
6月30日以降の残り所要積数 2,400
平均 100

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	

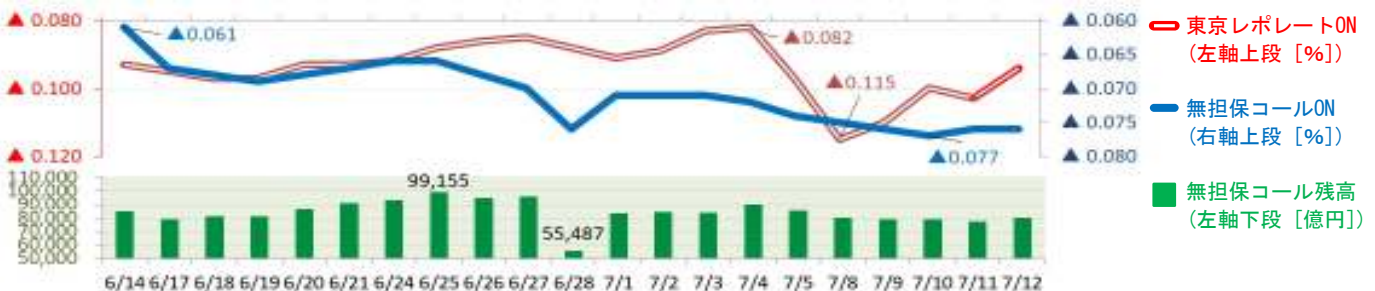
今月の国債買入オペ予定

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29日	0
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29日	0
10年超25年以下	500~2,000	1,200	3 29	6月29日	0
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