

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月8日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月2日	6月3日	6月4日	6月5日
加重平均金利	▲0.059	▲0.068	▲0.064	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.097	▲0.098	▲0.094
無コール残	130,723	127,334	136,031	135,147
ON	80,959	78,270	84,067	84,513
その他	49,764	49,064	51,964	50,634
有コール残	19,118	18,750	21,079	18,642

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。

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	▲0.055	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.035	▲0.049	▲0.088
2W	-	-	0.300	▲0.093
3W	-	-	▲0.065	▲0.100
1M	-	-	-	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
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

6月9日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック(5月)	-	(米) FOMC(1日目)	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.060%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%～▲0.05%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.055%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.055	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばいを予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 6月8日	日銀予想 6月9日	当社需給予想 6月10日
券	+300	▲200	+0
財政	▲40,600	+9,000	▲4,000
過不足	▲40,300	+8,800	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+10,900		
CP等買入	▲200	▲500	+6,000
国債補完供給	+300	▲400	+400
当座預金増減	▲29,700	+14,700	▲4,000
当座預金残高	4,140,200	4,154,900	4,150,900
準備預金残高	3,569,500	主な需給要因	
積み終了先	3,569,300		
超過準備	3,569,300		
非準備先残高	570,700		
準備預金進捗率	99.9%	国庫短期証券 発行・償還(6M)	
平均	77.4%		
乖離率	22.5%		

6月8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 按分

米ドル資金供給(6/10~6/17)
172 172 0.320 0.320

国債補完供給(6/8~6/9)
382 382 ▲0.350 ▲0.350
0 0

マネタリーベース [億円]
6月5日時点 5,334,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,399,300
6月9日以降の残り所要
積数 1,400
平均 200

国庫短期証券入札予定

6月9日	6ヶ月	第913回
6月12日	3ヶ月	第914回
6月15日	6ヶ月	第915回
6月18日	1年	
国債入札予定		
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月30日	2年	
7月2日	10年	

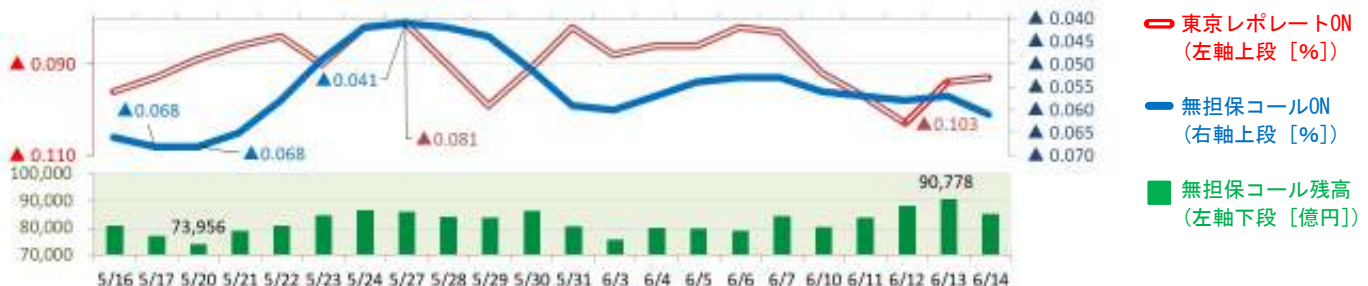
今月の国債買入オペ予定

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3日	2
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	1 5 12 17 22 26	6月5日	4
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月5日	4
5年超10年以下	2,500~5,500	4,000	5 10 17 22 29	6月5日	4
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1日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	6月1日	1
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5月積み期 [5月16日~6月14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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会