

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月15日(月)

## 短期市場の推移

	6月9日	6月10日	6月11日	6月12日
加重平均金利	▲0.048	▲0.038	▲0.031	▲0.023
東京レポレート(ON)	▲0.064	▲0.059	▲0.048	▲0.059
無コール残	121,033	113,058	111,675	119,805
ON	71,014	65,544	63,311	70,796
その他	50,019	47,514	48,364	49,009
有コール残	19,044	19,525	18,427	18,853

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16日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
17:00	業態別の日銀当座預金残高(5月)	-	21:30	(米)5月小売売上高 7.8%
-	6月日銀金融政策決定会合(日銀当座預金)	▲0.1%	22:15	(米)5月鉱工業生産指数[前月比] 3.0%
-	政策委員会・金融政策決定会合の決定内容	-	23:00	(米)4月企業在庫 -0.6%

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	▲0.060	0.001	▲0.018	▲0.093
T/N	-	-	-	▲0.072
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.080
2W	▲0.065	▲0.020	▲0.040	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.164
1Y	-	-	-	▲0.187

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.015%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+0.005%の▲0.018%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.015	▲0.018 ~ ▲0.005	▲0.040 ~ ▲0.010

## 翌営業日のマーケット

新積み期となることで、ビッドサイドの動きは慎重になるだろう。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月15日	6月16日	6月17日
券	▲200	▲200	+0
財政	+24,000	▲26,000	+2,000
過不足	+23,800	▲26,200	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,000		
共通担保(全店)	▲4,000		
CP等買入	▲500	▲200	+6,000
社債等買入	+3,000		
国債補完供給	+300	▲100	+100
当座預金増減	+31,800	▲26,300	+8,000
当座預金残高	4,231,500	4,205,200	4,213,200
準備預金残高	3,658,500	主な需給要因	
積み終了先	3,658,500	国庫短期証券発行(6M)	
超過準備	3,658,500		
非準備先残高	573,000		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

## 6月15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
米ドル資金供給(6/17~6/24)	170	170	0.340	0.340		
国債補完供給(6/15~6/16)	129	129	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [ 億円 ]  
6月12日時点 5,366,100

所要 [ 億円 ]  
来積み期の所要準備額 3,320,800  
6月16日以降の残り所要  
積数 3,320,800  
平均 110,700

## 国庫短期証券入札予定

6月18日	1年	第916回
6月19日	3ヶ月	第917回
6月26日	3ヶ月	
7月3日	3ヶ月	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月30日	2年	
7月2日	10年	

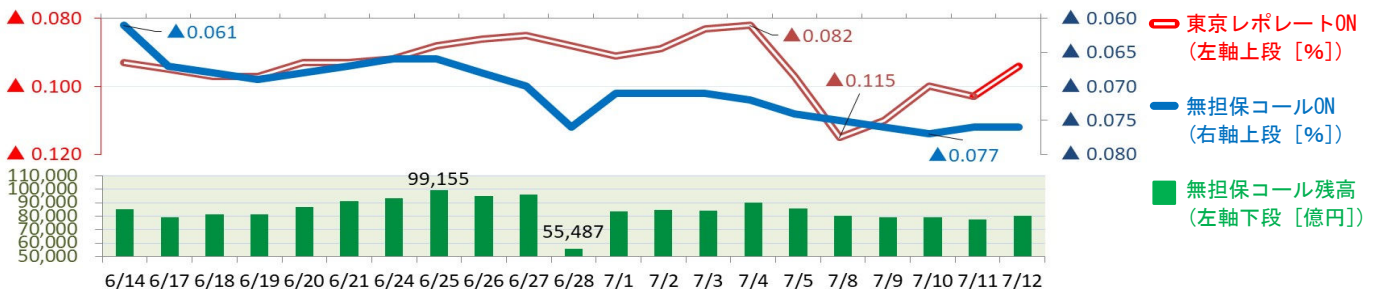
## 今月の国債買入オペ予定

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10日	1
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	1 5 12 17 22 26	6月12日	3
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月12日	2
5年超10年以下	2,500~5,500	4,000	5 10 17 22 29	6月10日	3
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。