

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年6月5日(水)

## 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	5月30日	5月31日	6月3日	6月4日
加重平均金利	▲0.051	▲0.059	▲0.060	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.082	▲0.088	▲0.086
無コール残	86,302	80,506	75,534	79,891
ON	54,687	49,601	46,279	49,716
その他	31,615	30,905	29,255	30,175
有コール残	18,971	21,980	18,982	20,629

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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
17:25	【講演】黒田総裁 (国際金融協会春季総会)	-	20:45	(欧)6月欧中銀(ECB) 政策金利	0.0%
-	-	-	21:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分]	-
-	-	-	21:30	(米)4月貿易収支	-505億米ドル

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	▲0.075	0.001	▲0.054	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.025	▲0.030	▲0.087
2W	-	-	▲0.020	▲0.095
3W	-	-	▲0.005	▲0.107
1M	-	-	▲0.015	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.158

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、▲0.060%の合出から始まった。その後は主に▲0.065%~▲0.045%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比+0.003%の▲0.054%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060		▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.065 ~ ▲0.045

## 翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、出合いの水準は本日と横ばいを予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月5日	6月6日	6月5日	6月6日	6月7日	6月8日
券	+900	▲200	+900	▲200	+0	+0
財政	▲19,800	+2,700	▲19,800	+2,700	▲5,000	▲5,000
過不足	▲18,900	+2,500	▲18,900	+2,500	▲5,000	▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入		+2,500				+2,500
CP等買入	▲100		▲200			
ETF買入	+100		+100			
当座預金増減	▲16,400	+2,400	▲16,400	+2,400	▲2,500	▲2,500
当座預金残高	3,917,100	3,919,500	3,917,100	3,919,500	3,917,000	3,917,000
準備預金残高	3,427,300	主な需給要因				
積み終了先	3,427,100					
超過準備	3,427,100					
非準備預金残高	489,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	67.7%					
乖離率	32.2%					

## 6月5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
国債補完供給(6/5~6/6)	10,756	3	3	▲0.600	▲0.600	
	20,000	0	0			

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月4日時点 5,050,500	今積期の所要準備額 3,195,000
	6月6日以降の残り所要積数 1,600
	平均 200

## 国庫短期証券入札予定

6月6日	6ヶ月	第836回
6月7日	3ヶ月	第837回
6月14日	3ヶ月	
6月19日	1年	
6月13日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月27日	2年	

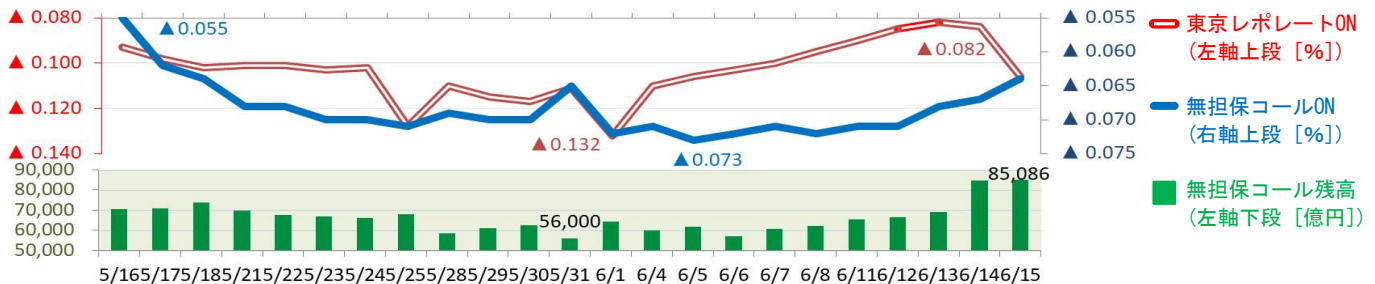
## 今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	6月3日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 10 21 26	6月3日	3
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	7 14 21 28	5月31日	4
10年超25年以下	1,000~3,000 程度	1,600			
25年超	100~1,000 程度	400	7 19 28	5月31日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	5月21日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月10日	1

## 1年前の市場推移

○2018年5月積み期 [5月16日~6月15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