

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年6月12日(水)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	6月6日	6月7日	6月10日	6月11日
加重平均金利	▲0.053	▲0.053	▲0.056	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.083	▲0.092	▲0.097
無コール残	78,889	84,510	80,363	83,933
ON	49,509	54,630	49,783	53,653
その他	29,380	29,880	30,580	30,280
有コール残	20,101	21,334	19,814	20,069

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]

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	▲0.058	▲0.103
T/N	-	-	-	▲0.113
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.120
2W	▲0.050	▲0.020	▲0.030	▲0.124
3W	-	-	-	▲0.133
1M	-	-	-	▲0.134
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.157

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、▲0.06%の出合から始まった。その後は主に▲0.07%~▲0.05%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比▲0.001%の▲0.058%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.065	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.080 ~ ▲0.045

## 翌営業日のマーケット

積終盤であるが調達ニーズは限定的と思われる。出合いの水準は若干の低下を予想。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月12日	6月13日	6月12日	6月13日	6月14日	6月15日
券		+100		▲800		▲1,000
財政		▲5,700		+3,800		+67,000
過不足		▲5,600		+3,000		+66,000
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		+5,000				
共通担保(全店)					▲700	
CP等買入	▲600		▲100			+2,500
社債等買入	▲100		▲100			
ETF買入		+700		+100		
被災地金融機関支援					▲2,300	
国債補充供給	+200	▲800	+800			
当座預金増減		▲1,200		+3,700		+65,500
当座預金残高		3,931,000		3,934,700		4,000,200
準備預金残高		3,426,000	主な需給要因			
積み終了先		3,425,900				
超過準備		3,425,900				
非準備預金残高		505,000				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.3%				
乖離率		9.6%				

## 6月12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
国債補充供給(6/12~6/13)	107,030	791	791	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
6月11日時点 5,046,800

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,198,000  
6月13日以降の残り所要積数 400  
平均 100

## 国庫短期証券入札予定

6月14日	3ヶ月	第838回
6月19日	1年	第839回
6月21日	3ヶ月	
6月28日	3ヶ月	
6月13日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月27日	2年	

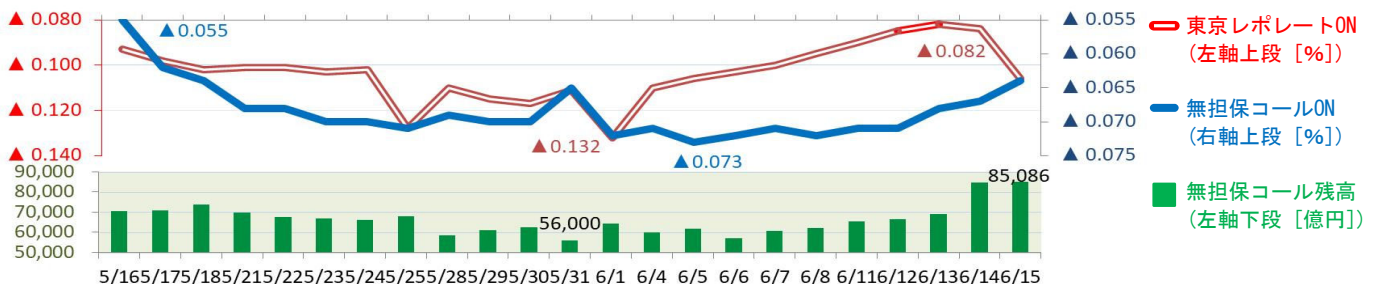
## 今月の国債買入オペ予定

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10日	2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	7 14 21 28	6月7日	3
10年超25年以下	1,000~3,000 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	400	7 19 28	6月7日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	6月10日	1
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