

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年6月20日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月14日	6月17日	6月18日	6月19日
加重平均金利	▲0.061	▲0.067	▲0.068	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.095	▲0.097	▲0.097
無コール残	85,087	79,124	81,525	81,309
ON	56,807	47,334	47,815	46,739
その他	28,280	31,790	33,710	34,570
有コール残	24,718	21,348	18,530	19,800

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21日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	5月消費者物価コア指数[前年比]	+0.8%	22:45	(米)6月製造業PMI	50.8
-	【記者会見】黒田総裁(6月20日)	-	23:00	(米)5月中古住宅販売件数	530.0万件

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

本日の市況

	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	▲0.086	0.001	▲0.068	▲0.093
T/N	-	-	▲0.075	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.070	▲0.098
2W	-	-	-	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.116
1M	-	-	-	▲0.121
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.159

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

本日の無担保コールON物は、▲0.070%の合出から始まった。その後は主に▲0.075%~▲0.060%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▲0.068%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.075		▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため、本日対比で若干出合水準が上昇すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 6月20日	日銀予想 6月21日	当社需給予想 6月24日
券	▲1,900	▲1,100	+0
財政	+85,300	+5,500	▲1,000
過不足	+83,400	+4,400	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+3,500	-	-
共通担保(全店)	-	▲300	▲2,500
CP等買入	▲200	▲100	-
社債等買入	▲1,300	▲100	+1,300
国債補完供給	+300	+100	-
当座預金増減	+85,600	+4,100	▲2,200
当座預金残高	4,084,900	4,089,000	4,086,800
準備預金残高	3,545,400	主な需給要因	
積み終了先	3,542,700	国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	3,538,300		
非準備預金残高	539,500		
準備預金進捗率	99.5%		
平均	16.7%		
乖離率	82.8%		

6月20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(6/20~6/21)	386,958	54	54	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
6月19日時点 5,115,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,090,900
6月21日以降の残り所要積数 15,100
平均 600

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

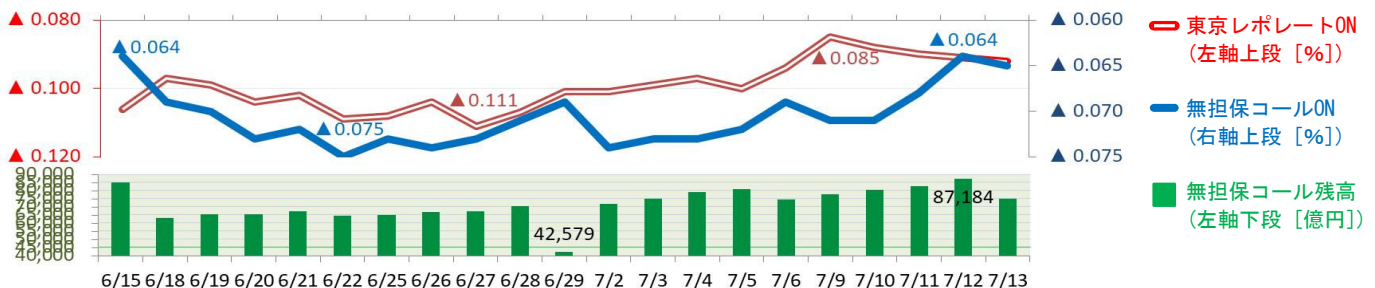
6月21日	3ヶ月	第840回
6月28日	3ヶ月	
7月5日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
6月25日	20年	
6月27日	2年	
7月2日	10年	
7月4日	30年	

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19日	0
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14日	2
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19日	1
物価運動債	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	6月14日	0

1年前の市場推移

○2018年6月積み期 [6月15日~7月13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