

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年6月21日(金)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月17日	6月18日	6月19日	6月20日
加重平均金利	▲0.067	▲0.068	▲0.069	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.095	▲0.097	▲0.097	▲0.093
無コール残	79,124	81,525	81,309	86,698
ON	47,334	47,815	46,739	52,218
その他	31,790	33,710	34,570	34,480
有コール残	21,348	18,530	19,800	21,803

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24日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (6月20日現在)	-	21:30	(米)5月シカゴ連銀 全米活動指数
	-			0.10
	-			
	-			

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	▲0.067	▲0.093
T/N	-	-	▲0.075	▲0.090
S/N	-	-	▲0.075	-
1W	▲0.080	0.000	▲0.063	▲0.102
2W	-	-	▲0.025	▲0.105
3W	-	-	▲0.045	▲0.111
1M	-	-	-	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.151
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

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.070%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.060%のレンジで取引された。同加重平均金利は前営業日対比+0.001%の▲0.067%となった。

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

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、合出の水準は本日と横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月21日	6月24日	6月24日	6月25日	6月25日	6月25日
券	▲1,200	▲700	▲700	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+5,900	+400	+400	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	+4,700	▲300	▲300	▲2,000	▲2,000	▲2,000
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
国債買入				+12,800		
共通担保(全店)			▲2,500	+3,700		
CP等買入	▲300		▲300			
社債等買入	▲100			+1,300		
ETF買入				+900		
国債補完供給	+100	▲300	+300			
当座預金増減	+4,100	+15,900	+15,900	▲2,000	▲2,000	▲2,000
当座預金残高	4,089,000	4,104,900	4,104,900	4,102,900	4,102,900	4,102,900
準備預金残高	3,586,200					
積み終了先	3,584,000					
超過準備	3,583,800					
非準備預金残高	502,800					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	26.7%					
乖離率	73.1%					

6月21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
国債買入(6/24~)						
1~3年	3,500	9,629	3,502	▲0.007	▲0.004	72.1
3~5年	4,000	9,635	4,000	▲0.032	▲0.020	20.7
5~10年	4,800	10,616	4,802	▲0.021	▲0.015	9.8
国債補完供給(6/21~6/24)						
125,108	290	290	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(6/24~7/8)						
15,000	3,666	3,666				

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月20日時点 5,203,000	今積期の所要準備額 3,090,900
	6月24日以降の残り所要積数 7,700
	平均 300

国庫短期証券入札予定

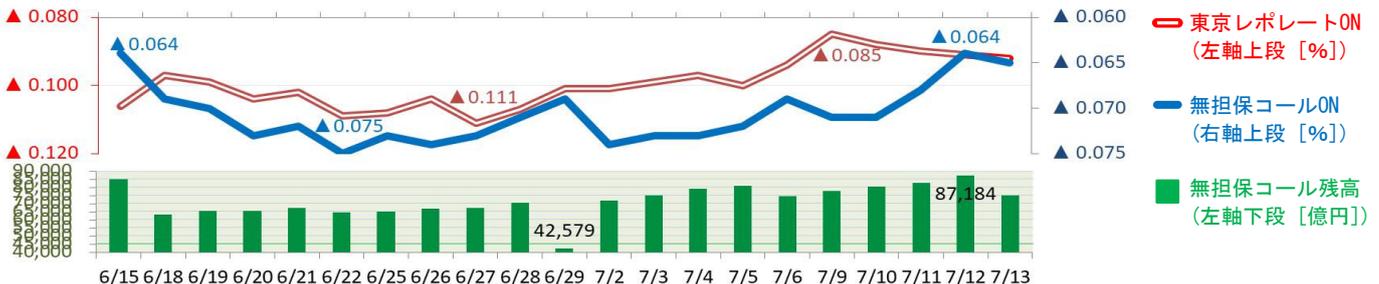
今月の国債買入オペ予定

国債入札予定	国庫短期証券入札予定	今月の国債買入オペ予定
6月28日 3ヶ月 第841回	6月28日 3ヶ月 第841回	オペ種類
7月5日 3ヶ月	7月5日 3ヶ月	1年以下
7月9日 6ヶ月	7月9日 6ヶ月	1年超3年以下
7月12日 3ヶ月	7月12日 3ヶ月	3年超5年以下
国債入札予定	国債入札予定	5年超10年以下
6月25日 20年	6月25日 20年	10年超25年以下
6月27日 2年	6月27日 2年	25年超
7月2日 10年	7月2日 10年	物価連動債
7月4日 30年	7月4日 30年	変動利付債<偶数月>

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