

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年6月25日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月19日	6月20日	6月21日	6月24日
加重平均金利	▲0.069	▲0.068	▲0.067	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.093	▲0.093	▲0.092
無コール残	81,309	86,698	91,345	93,555
ON	46,739	52,218	54,915	56,665
その他	34,570	34,480	36,430	36,890
有コール残	19,800	21,803	22,385	22,397

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26日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-	-	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
	-	-	21:30	(米)5月耐久財受注[前月比]
	-	-	-	0.3%

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	▲0.066	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.098
2W	-	-	-	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	-	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
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(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.065 ~ ▲0.065	▲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 6月25日	日銀予想 6月26日	当社需給予想 6月27日
券	▲1,000	▲1,200	▲2,000
財政	+4,900	▲10,800	+2,000
過不足	+3,900	▲12,000	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+5,000
CP等買入	▲500	▲100	
社債等買入	▲200	▲100	
ETF買入			+300
国債補完供給	+600		
当座預金増減	+3,800	▲6,900	+0
当座預金残高	4,106,900	4,100,000	4,100,000
準備預金残高	3,596,900	主な需給要因	
積み終了先	3,596,100		
超過準備	3,596,000		
非準預先残高	510,000	国債発行(20年)	
準備預金進捗率	99.8%		
平均	33.3%		
乖離率	66.5%		

6月25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
国庫短期証券買入(6/26~)	5,000	22,566	5,000	0.017	0.023	21.9
米ドル資金供給(6/27~7/5)			0	2.890	2.890	
CP等買入(6/28~)	2,500	5,695	2,480	▲0.003	0.002	29.8
国債補完供給(6/25~6/26)	125,211	16	16	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月24日時点 5,223,400	今積期の所要準備額 3,090,900
	6月26日以降の残り所要積数 5,700
	平均 300

国庫短期証券入札予定

6月28日	3ヶ月	第841回
7月5日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月12日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月27日	2年	
7月2日	10年	
7月4日	30年	
7月9日	5年	

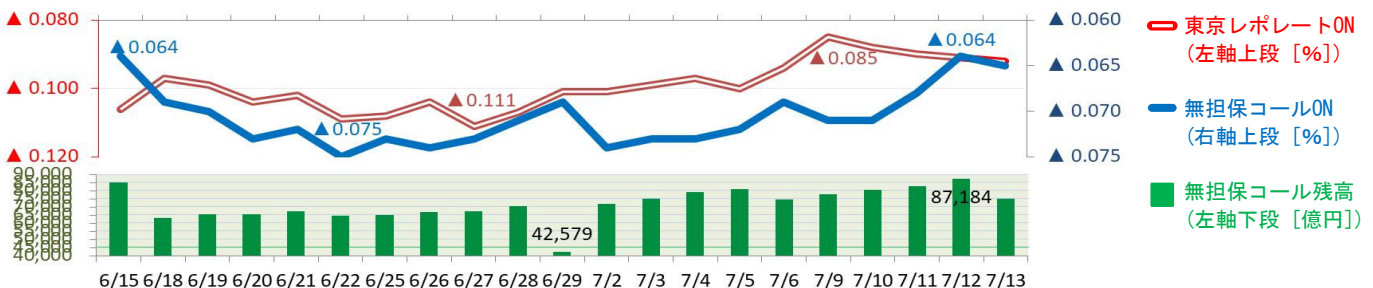
今月の国債買入オペ予定

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19日	0
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500		6月21日	1
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 10 21 26	6月21日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	7 14 21 28	6月21日	1
10年超25年以下	1,000~3,000 程度	2,000		6月19日	1
25年超	100~1,000 程度	400	7 19 28	6月10日	1
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	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