



デイリーシグナル

2021年6月9日(水)

短期市場の推移

	6月3日	6月4日	6月7日	6月8日
加重平均金利	▲0.037	▲0.034	▲0.032	▲0.029
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.076	▲0.072	▲0.070
無コール残	123,979	131,800	114,013	121,665
ON	69,028	76,519	59,470	65,702
その他	54,951	55,281	54,543	55,963
有コール残	19,109	20,680	20,445	19,405

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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。
 本日の短期市場金利 [％]

	無担保コール(速報)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.055	0.001	▲0.026	▲0.063
T/N	▲0.015	▲0.001	▲0.005	▲0.065
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.011	▲0.008	▲0.009	▲0.068
2W	▲0.010	▲0.003	▲0.006	▲0.077
3W	-	-	-	▲0.085
1M	-	-	0.080	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.133

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

6月10日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	貸出約定平均金利 (4月)	-	(米)消費者物価指数		3.4%
8:50	企業物価指数 (5月)	-	(欧)ECB理事会 ラガルド総裁の会見		

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.023%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.010%で出合が見られた。引き続き地銀を中心としたビッドサイドの資金調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.026%となった。また、日本銀行は6月積み期間におけるマクロ加算残高の算出に用いる基準比率を19.0%に定めることとした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

堅調な地合は継続すると思われる、出合水準は本日対比で若干の上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月9日	6月10日	6月10日	6月11日	6月11日	6月11日
券	+100	▲400	▲400	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	▲12,200	▲5,000	▲5,000	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	▲12,100	▲5,400	▲5,400	+0	+0	+0
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	+15,000					
国債買入		+14,600				
共通担保(全店)	▲3,400	+3,400				
CP等買入	▲100		▲300		▲500	
社債等買入	▲100		+1,300			
被災地金融機関支援					▲500	+600
当座預金増減	+2,700	+10,200	+10,200	▲400	▲400	▲400
当座預金残高	5,192,400	5,202,600	5,202,600	5,202,200	5,202,200	5,202,200
準備預金残高	4,585,500					
積み終了先	4,585,500					
超過準備	4,585,500					
非準備預金先高	606,900					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	80.6%					
乖離率	19.4%					

6月9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	按分
国債買入(6/10~)						
1~3年	4,750	19,442	4,752	0.005	0.006	43.0
3~5年	4,500	13,190	4,506	▲0.001	▲0.001	89.7
5~10年	4,500	10,204	4,507	▲0.005	▲0.003	2.4
物価連動	600	3,318	603	▲0.330	▲0.352	37.7
国債補充供給(6/9~6/10)						
	0	0				
	0	0				

マネタリーベース [億円]
6月8日時点 6,397,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,750,800
6月10日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

6月11日	3ヶ月(第1000回)
6月15日	6ヶ月(第1001回)
6月16日	1年(第1002回)
6月17日	3ヶ月
6月22日	5年
6月24日	20年
6月29日	2年
7月1日	10年

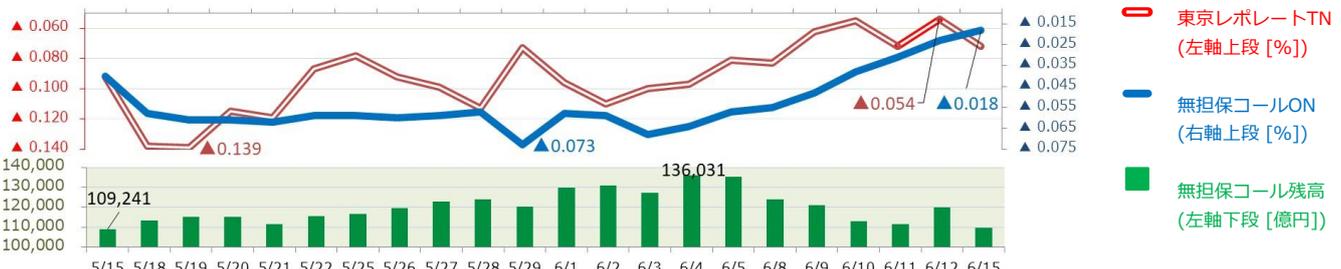
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回程度	5月28日	1
1年超3年以下	4750	4,750	2 9 16 23	6月9日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 16 28	6月9日	2
5年超10年以下	4500	4,500	9 16 23 28	6月9日	3
10年超25年以下	2000	2,000	2 28	6月2日	0
25年超	500	500		5月20日	1
物価連動債	600	600	月1回程度	6月9日	0
変動利付債<四半期>	300	300	-	4月21日	-

1年前の市場推移

○2020年5月積み期 [5月15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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会