



デイリーシグナル

2021年6月11日(金)

短期市場の推移

	6月7日	6月8日	6月9日	6月10日
加重平均金利	▲0.032	▲0.029	▲0.026	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.072	▲0.070	▲0.065	▲0.074
無コール残	114,013	121,665	115,406	125,553
ON	59,470	65,702	60,043	64,960
その他	54,543	55,963	55,363	60,593
有コール残	20,445	19,405	19,933	19,461

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。

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	▲0.060	0.001	▲0.016	▲0.071
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.006	▲0.073
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.076
2W	-	-	-	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	-	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.133

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

6月14日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	13:30	鉱工業生産 (4月)		-
	-		-	
	-		-	

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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%で出合が見られた。週末3日積みであったため調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.020	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

積み終盤に入り、地銀業態を中心に調達ニーズが強く、出合いの水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月11日		6月14日		6月15日	
券	+100		▲100		+0	
財政	▲2,100		+4,000		+78,000	
過不足	▲2,000		+3,900		+78,000	
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
CP等買入	▲900		▲300			
被災地金融機関支援	▲500	+600				
国債補完供給	+200	▲500	+500			
新型コロナ対応金融支援特別	▲200					
当座預金増減	▲3,300		+4,100		+78,000	
当座預金残高	5,197,800		5,201,900		5,279,900	
準備預金残高	4,612,700		主な需給要因			
積み終了先	4,612,700		源泉税揚げ		年金定時払い	
超過準備	4,612,700		国庫短期証券		国債発行償還	
非準備先残高	585,100		発行償還(3M)		(個人向け)	
準備預金進捗率	100.0%					
平均	93.5%					
乖離率	6.5%					

6月11日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債補完供給(6/11~6/14)	
509	509 ▲0.350 ▲0.350
0	0

マネタリーベース (億円)
6月10日時点 6,409,100

所要 (億円)	
今積期の所要準備額	3,750,800
6月14日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

入札日	入札期間
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(第1003回)
6月25日	3ヶ月

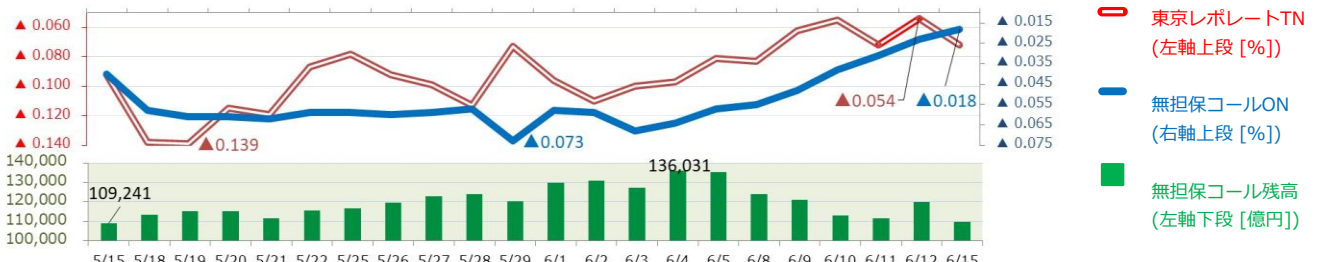
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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	6月2日	0
25年超	500	500	28	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