



デイリーシグナル

2021年6月18日(金)

短期市場の推移

	6月14日	6月15日	6月16日	6月17日
加重平均金利	▲0.015	▲0.013	▲0.034	▲0.028
東京レポレート(TN)	▲0.081	▲0.086	▲0.085	▲0.084
無コール残	120,397	127,507	135,412	142,787
ON	67,874	78,344	80,441	87,096
その他	52,523	49,163	54,971	55,691
有コール残	20,130	18,975	20,812	20,044

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	▲0.070	0.001	▲0.027	▲0.081
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.003	▲0.084
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.035	▲0.010	▲0.018	▲0.085
2W	-	-	▲0.025	▲0.089
3W	-	-	0.170	▲0.091
1M	-	-	▲0.007	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.011	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.131

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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
【記者会見要旨】黒田総裁 (6月18日分)			
-		-	
-		-	

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▲0.025%の出かから始まり、その後は主に▲0.050%～▲0.015%で出が見られた。3日積みであり様々な業態の調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.027%となった。日本銀行は本日の金融政策決定会合にて、金融政策の現状維持を決定した。また新型コロナウイルス感染症対応金融支援特別オペの期限を半年間延長するとともに、気候変動関連に対応する新たな資金供給の仕組みを導入することを発表した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因が剥落し、出合いの水準は本日対比で横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月18日		6月21日		6月22日	
券	▲500		▲300		+0	
財政	+10,900		+47,900		+1,000	
過不足	+10,400		+47,600		+1,000	
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	▲400		▲500			
社債等買入	▲800					
国債補完供給	+600	▲100	+100			
貸出増加支援	▲24,100		+26,500			
当座預金増減	+12,100		+47,200		+1,000	
当座預金残高	5,308,100		5,355,300		5,356,300	
準備預金残高	4,658,400					
積み終了先	4,657,900		国庫短期証券			
超過準備	4,653,700		発行償還(3M・1Y)			
非準備先残高	649,700		国債償還			
準備預金進捗率	99.9%		(5年・10年・20年)			
平均	16.7%					
乖離率	83.2%					

6月18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
国債補完供給(6/18~6/21)	92	92	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
6月17日時点 6,505,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,632,600
6月21日以降の残り所要	
積数	4,800
平均	200

国庫短期証券入札予定

6月25日	3ヶ月(第1004回)
7月2日	3ヶ月
7月8日	6ヶ月
7月9日	3ヶ月

国債入札予定

6月22日	5年
6月24日	20年
6月29日	2年
7月1日	10年

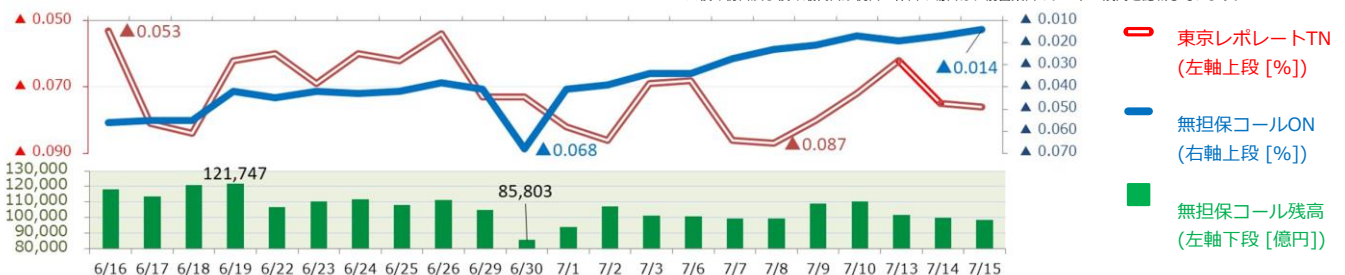
今月の国債買入オペ予定

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16日	1
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 16 28	6月16日	1
5年超10年以下	4500	4,500	9 16 23 28	6月16日	2
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6月積み期 [6月16日~7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