



デイリーシグナル

2022年6月15日(水)

短期市場の推移

	6月9日	6月10日	6月13日	6月14日
加重平均金利	▲0.029	▲0.025	▲0.033	▲0.034
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.085	▲0.091
無コール残	156,821	152,855	136,378	129,182
ON	79,728	77,912	62,505	57,314
その他	77,093	74,943	73,873	71,868
有コール残	29,815	30,753	30,537	30,528

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	▲0.023	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.005	▲0.021	▲0.108
2W	▲0.045	▲0.015	▲0.031	▲0.107
3W	-	-	-	▲0.118
1M	0.010	0.020	0.014	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.200	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.111
1Y	-	-	-	▲0.111

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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	5月貿易収支	-20672億円	3:00	(米)6月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利	1.5%
	日銀金融政策決定会合(1日目)		21:30	(米)5月住宅着工件数	171.7万戸

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.010%の水準で取引された。積み最終日ということもあり、ビッドサイドの調達意欲が強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.011%の▲0.023%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

積み初日となる明日は、ビッドサイドが慎重な動きとなるため、出合いの水準は本日対比で低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月15日	6月16日	6月15日	6月16日	6月15日	6月16日
券	▲400	▲800	▲400	▲800	▲1,000	▲1,000
財政	+71,200	+2,500	+71,200	+2,500	+0	+0
過不足	+70,800	+1,700	+70,800	+1,700	+1,000	+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
国債買入		+31,800		+37,200		+37,200
CP等買入	▲500		▲200			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+4,700	▲16,000	+16,000			
当座預金増減	+90,700	+54,700	+90,700	+54,700	+1,000	+1,000
当座預金残高	5,493,200	5,547,900	5,493,200	5,547,900	5,546,900	5,546,900
準備預金残高	4,826,700		4,826,700			
積み終了先						
超過準備	4,826,700		4,826,700			
非準備先残高	666,500		666,500			
準備預金進捗率	100.0%		100.0%			
平均	100.0%		100.0%			
乖離率	0.0%		0.0%			

6月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(6/16~)						
5~10年	5,443	5,443				
5~10年	7,212	7,212				
国債買入(6/16~)						
1~3年	6,250	12,521	6,250	▲0.035	▲0.026	82.7
3~5年	6,250	8,904	6,251	▲0.058	▲0.049	79.4
5~10年	8,000	25,778	8,007	▲0.020	▲0.011	22.2
10~25年	2,500	6,031	2,507	▲0.050	▲0.034	32.3
25年~	1,500	2,834	1,500	▲0.081	▲0.066	96.7
国債補完供給(6/15~6/16)						
	15,862	15,862	▲0.350	▲0.350		
	171	171	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース	所要
6月14日時点	6,646,200

所要	所要準備額
来積期の所要準備額	3,743,800
6月16日以降の残り所要	
積数	3,743,800
平均	124,800

国債短期証券入札予定

6月16日	3ヶ月(第1089回)
6月24日	3ヶ月
7月1日	3ヶ月
7月7日	6ヶ月
6月21日	5年
6月23日	20年
6月28日	2年
7月5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	6月3日	0
1年超3年以下	4750	6,250	3 8 15 22	6月15日	1
3年超5年以下	4750	6,250	3 8 15 29	6月15日	1
5年超10年以下	5000	8,000	8 15 22 29	6月15日	2
10年超25年以下	1250	2,500	8 15 29	6月15日	1
25年超	500	1,500	3 15 22	6月15日	1
物価連動債	600	600	月1回	5月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	-

1年前の市場推移

○2021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