



デイリーシグナル

2022年6月16日(木)

| 短期市場の推移 [徳円] [%] | | | | | 6月17日の予定 (時刻は日本時間) | | | | | |
|------------------|---------|---------|---------|---------|------------------------|--|-------|-------|-------------------|-------|
| | 6月10日 | 6月13日 | 6月14日 | 6月15日 | 日本 | | 海外 | | 予想 | |
| 加重平均金利 | ▲0.025 | ▲0.033 | ▲0.034 | ▲0.023 | 6月1日銀金融政策決定会合 (日銀当座預金) | | ▲0.1% | 22:15 | (米)5月鉱工業生産指数[前月比] | 0.4% |
| 東京レポレート(TN) | ▲0.086 | ▲0.085 | ▲0.091 | ▲0.100 | | | | 23:00 | (米)5月景気先行指数 | ▲0.4% |
| 無コール残 | 152,855 | 136,378 | 129,182 | 139,011 | | | | | | |
| ON | 77,912 | 62,505 | 57,314 | 67,893 | | | | | | |
| その他 | 74,943 | 73,873 | 71,868 | 71,118 | | | | | | |
| 有コール残 | 30,753 | 30,537 | 30,528 | 29,782 | | | | | | |

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。

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 [%] | | | | 本日の市況 | | |
|---------------|--------|--------|---------|--|--|--|
| 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 | ▲0.042 | 本日の無担保コールON物は▲0.035%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.030%の水準で取引された。積み期が変わったことで調達ニーズが弱くなり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.019%の▲0.042%と大きく低下した。 | | |
| T/N | - | - | ▲0.029 | | | |
| S/N | - | - | - | | | |
| 1W | ▲0.040 | 0.010 | ▲0.034 | | | |
| 2W | ▲0.040 | ▲0.015 | ▲0.032 | | | |
| 3W | - | - | - | | | |
| 1M | ▲0.035 | 0.005 | ▲0.027 | | | |
| 2M | - | - | - | | | |
| 3M | - | - | - | | | |
| 6M | - | - | - | | | |
| 1Y | - | - | - | | | |

| 都銀・信託 | | | 証券 | 地銀 |
|-----------------|--|--|----|-----------------|
| ▲0.065 ~ ▲0.055 | | | - | ▲0.050 ~ ▲0.030 |

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重な調達姿勢は変わらず、出合いの水準は本日対比横ばいを予想。

| 資金需給 [徳円] | | | | 6月16日のオペ結果 [%][徳円] ※米ドル資金供給は百万\$ | | | | |
|-----------|-----------|-----------|-----------|----------------------------------|--|--------------------------|--|--|
| 日銀速報 | | 日銀予想 | | 当社需給予想 | | オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分 | | |
| 6月16日 | | 6月17日 | | 6月20日 | | | | |
| 券 | ▲900 | ▲600 | ▲1,000 | 国債買入(固定利回り方式)(6/17~) | | | | |
| 財政 | ▲1,900 | +11,100 | +80,000 | 5~10年 6,805 6,805 | | | | |
| 過不足 | ▲2,800 | +10,500 | +79,000 | 5~10年 533 533 | | | | |
| 金融調節 | エンド | スタート | エンド | 国債補充供給(6/16~6/17) | | | | |
| 国債買入 | +37,200 | +7,300 | | 30,998 30,998 ▲0.350 ▲0.350 | | | | |
| CP等買入 | ▲200 | ▲100 | | 1,281 1,281 ▲0.350 ▲0.350 | | | | |
| 社債等買入 | | ▲300 | | 貸出増加を支援するための資金供給(6/20~2026/6/19) | | | | |
| 国債補充供給 | +16,000 | +32,200 | +32,200 | 46,265 | | | | |
| 貸出増加支援 | | | ▲17,600 | | | | | |
| | | | +46,300 | | | | | |
| 当座預金増減 | +18,000 | +49,600 | +107,700 | | | | | |
| 当座預金残高 | 5,511,200 | 5,560,800 | 5,668,500 | | | | | |
| 準備預金残高 | 4,846,200 | 主な需給要因 | | | | | | |
| 積み終了先 | 3,497,600 | 国債大量償還 | | | | | | |
| 超過準備 | 1,471,600 | 国庫短期証券 | | | | | | |
| 非準備預金残高 | 665,000 | 発行・償還(3M) | | | | | | |
| 準備預金進捗率 | 90.1% | | | | | | | |
| 平均 | 3.3% | | | | | | | |
| 乖離率 | 86.8% | | | | | | | |

| マネタリーベース [徳円] | | 所要 [徳円] | |
|-------------------|--|---------------------|--|
| 6月15日時点 6,737,400 | | 今積期の所要準備額 3,743,800 | |
| | | 6月17日以降の残り所要 | |
| | | 積数 369,200 | |
| | | 平均 12,700 | |

| 国庫短期証券入札予定 | | 今月の国債買入オペ予定 | | [徳円] | | | | | | |
|------------|-----|-------------|-------------|---------|---------|----|------|------|-------|---|
| 6月24日 | 3ヶ月 | 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 | | |
| 7月1日 | 3ヶ月 | 1年以下 | 1500 | 1,500 | 月1回 | | 6月3日 | 0 | | |
| 7月7日 | 6ヶ月 | 1年超3年以下 | 4750 | 6,250 | 3 | 8 | 15 | 22 | 6月15日 | 1 |
| 7月8日 | 3ヶ月 | 3年超5年以下 | 4750 | 6,250 | 3 | 8 | 15 | 29 | 6月15日 | 1 |
| 国債入札予定 | | 5年超10年以下 | 5000 | 8,000 | 8 | 15 | 22 | 29 | 6月15日 | 2 |
| 6月21日 | 5年 | 10年超25年以下 | 1250 | 2,500 | 8 | 15 | 29 | | 6月15日 | 1 |
| 6月23日 | 20年 | 25年超 | 500 | 1,500 | 3 | 15 | 22 | | 6月15日 | 1 |
| 6月28日 | 2年 | 物価連動債 | 600 | 600 | 月1回 | | | | 5月30日 | 1 |
| 7月5日 | 10年 | 変動利付債<四半期> | 300 | 300 | 四半期に1回 | | | | 4月8日 | - |



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