

DAILY SIGNAL

平成27年6月1日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは162兆3000億円だった。
本日の無担保コールON物は0.072%の出会いから始まり、その後は
0.07%前半まで取引された。後場に入ると調整程度の出合いが散見された。
ターム物は2Wで0.11%台後半の出合いが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,623,000	+1,623,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/1 のオペ結果
	6/1(月)		6/2(火)		6/3(水)		6/4(木)		
券	+900		+1,100		+1,000		+0		9:20
財政	▲18,600		▲30,700		▲13,000		+5,000		ノーオペ
過不足	▲17,700		▲29,600		▲12,000		+5,000		10:10
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	エンド	スタート	国債買入(6/3-)
国債買入				+11,600		+4,500			(残存1年以下)
国庫短期証券買入				+4,000					+0.033%按分(67.6%) 701億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									+0.015%按分(35.6%) 2408億
共通担保(全店)	▲2,200	+2,100	▲11,800	+5,600					(残存25年超)
CP買現先									+0.012%按分(29.0%) 1403億
CP等買入	▲500		▲100						11:50
社債等買入			▲100						国債補完供給(6/1-6/2)
ETF買入									▲0.400%(全取) 45億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給									ノーオペ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲18,300		▲20,400		▲7,500		+5,000		
当座預金残高	2,111,900		2,091,500		2,084,000		2,089,000		
準備預金残高	1,931,900		1,931,900		1,931,900		1,931,900		
積み終了先	1,621,700		1,621,700		1,621,700		1,621,700		
超過準備	1,621,700		1,621,700		1,621,700		1,621,700		
非準備預金残高	180,000		180,000		180,000		180,000		
準備預金進捗率	99.5%		99.5%		99.5%		99.5%		
平均	54.8%		54.8%		54.8%		54.8%		
乖離率	44.6%		44.6%		44.6%		44.6%		
共通担保(本店)									0
共通担保(全店)									74,557
国債買現先									0
CP買現先									0
成長基盤強化									46,757
被災地金融機関支援									3,244
ロンハート残高									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,012,300

6/2以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 10,700

6/2以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 800

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.080	0.060	0.070
ビッド	0.065	0.020	0.100	0.085
出来値	-	-	-	-

5/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,073,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	5/20
長期国債	142	202	234
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	5.0
J-REIT	0.14	0.18	0.22
貸出支援基金	9.2	25	28
国庫短期証券	40	49	51
その他とも資産計	224	300	338
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	211
その他とも負債・純資産計	224	300	338

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
5/28	535(3M)	0.0040%	0.0012%
5/21	534(3M)	0.0040%	0.0012%
5/18	533(1Y)	-0.0069%	-0.0079%

5/29のコール市場残高(前日比)

	合計	195,868	+160
有担	129,187	-2,481	
無担	66,681	+2,641	

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	0.055	0.065	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.122	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.084	-	-	0.118	0.118	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.052	0.071	-	0.051	0.045	0.041	0.037	-	0.034	0.041	0.054

§ 6/2 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は、0.07%前半まで取引されよう。
共通担保オペは期落ちがなく、ノーオペを予想する。

6/2 の予定(国内)

8:50 5月のマネタリーベース(日銀)
10:00 5月31日現在の営業毎旬報告(日銀)
10:30 4月の毎月勤労統計(厚労省)

6/2 の予定(海外)

米 4月の製造業受注指数
欧 5月のCPI速報値

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出合いレンジ予想																
即日オペ金額	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y								
◎	ノーオペ	▲20,400	2,091,500	+2,091,500	0.050	0.070	0.070	0.075	0.075	0.117	0.118	0.130	0.200							
					~	~	~	~	~	~	~	~	~							
					0.125	0.120	0.120	0.120	0.125	0.150	0.150	0.170	0.300							

共通担保資金供給(全店)					*当日物					共通担保資金供給(本店)					*当日物								
期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/6/2 ~ 2015/9/11	15,000	5,550	5,550	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/6/1 ~ 2015/8/31	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/5/29 ~ 2015/9/8	15,000	7,160	7,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ					期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率			
2015/5/26 ~ 2015/9/4	15,000	7,210	7,210	0.10%	固定金利	-	札割れ	5/29 ~ 6/4	担保範囲内	0	0	0.610%	固定金利	-	応札なし								
2015/5/25 ~ 2015/8/24	8,000	2,840	2,840	0.10%	固定金利	-	札割れ	5/21 ~ 5/29	担保範囲内	2	2	0.620%	固定金利	-	1.00								
2015/5/22 ~ 2015/9/1	15,000	7,256	7,256	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/5/19 ~ 2015/8/28	15,000	11,251	11,251	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/5/18 ~ 2015/8/17	8,000	1,331	1,331	0.10%	固定金利	-	札割れ																

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