

DAILY SIGNAL

平成27年6月2日(火)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは160兆9000億円だった。
本日の無担保コールON物は0.072%の出会いからスタート。
その後0.07%台前半で取引された。後場は調整程度のお合いが散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,609,000	+1,609,000

(単位: 億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/2 のオペ結果
	6/2(火)		6/3(水)		6/4(木)		6/5(金)		
券		+1,200		+1,000		+0		+0	9:20 ノーオペ
財政		▲31,300		▲6,600		+5,000		+4,000	10:10 ノーオペ
過不足		▲30,100		▲5,600		+5,000		+4,000	10:40 ノーオペ
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	12:50 ノーオペ
国債買入		+11,600		+4,800					13:00 ノーオペ
国庫短期証券買入		+4,000							米ドル資金供給 (6/4-6/11) 利率0.630% 0百万米ドル
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲11,800	+5,600							
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲100						
社債等買入	▲100								
ETF買入				+100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援 貸出									
国債補完供給									
成長基盤強化支援 貸出増加支援							▲7,400	+9,000	
当座預金増減		▲20,900		▲800		+5,000		+5,600	
当座預金残高		2,091,000		2,090,200		2,095,200		2,100,800	
準備預金残高		1,915,600	共通担保オペ当社予想						共通担保(本店) 0
積み終了先		1,608,800	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 68,307
超過準備		1,608,800							国債買現先 0
非準備預金残高		175,400							CP買現先 0
準備預金進捗率		99.5%							成長基盤強化 46,753
平均		58.1%	予想込増減	▲800	予想込増減	+5,000	予想込増減	+5,600	被災地金融機関支援 3,244
乖離率		41.5%	当預見込	2,090,200	当預見込	2,095,200	当預見込	2,100,800	ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,012,300
6/3 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 9,600
6/3 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 700

	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	0.065
ビッド	0.065	0.020	0.100	0.075
出来値	-	-	-	-

6/1 時点のマネタリーベース(単位: 億円) 3,054,600

(参考)日銀B/S(単位: 兆円)	13年末実績	14年末実績	5/31
長期国債	142	202	237
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	5.1
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	52
その他とも資産計	224	300	343
銀行券	90	93	90
当座預金	107	178	213
その他とも負債・純資産計	224	300	343

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%

6/1 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	195,628	-240	-416
	129,363	+176	
	66,265		

*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	0.060	0.066	-	0.118	0.118	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	0.200	0.340	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.083	0.125	0.159	0.149	0.118	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.052	0.069	-	0.051	0.045	0.041	0.037	-	0.035	0.041	0.054

§ 6/3 オファターのオペと市場動向予想

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

6/3 の予定(国内)

白井日銀審議委員が
三重県金融経済懇親会であいさつ、会見

6/3 の予定(海外)

米 ヘッジブック
5月ADP雇用統計
5月ISM非製造業指数

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想								
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	▲800	2,090,200	+2,090,200	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	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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
2015/6/1 ~ 2015/8/31	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/5/29 ~ 2015/9/8	15,000	7,160	7,160	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
2015/5/26 ~ 2015/9/4	15,000	7,210	7,210	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/5/25 ~ 2015/8/24	8,000	2,840	2,840	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/5/22 ~ 2015/9/1	15,000	7,256	7,256	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2015/5/19 ~ 2015/8/28	15,000	11,251	11,251	0.10%	固定金利	-	札割れ	6/4 ~ 6/11	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応れなし
2015/5/18 ~ 2015/8/17	8,000	1,331	1,331	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	-	応れなし

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。 上田八木証券株式会社 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