

DAILY SIGNAL

平成27年6月3日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは161兆1000億円だった。
本日の無担保コールON物は0.075%の出会いから始まり、その後は0.07~0.075%のレンジで取引された。後場に入ると調整程度の出合いが見られた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,611,000	+1,611,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/3 のオペ結果
	6/3(水)		6/4(木)		6/5(金)		6/8(月)		
券	+1,000		+300		+0		+1,000		9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(6/5-) (残存1年超3年以下) +0.004%按分(88.4%) 3750億 (残存3年超5年以下) +0.011%按分(74.1%) 4003億 (残存5年超10年以下) +0.028%按分(8.2%) 4007億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ 13:50 国債補完供給(6/3-6/4) ▲0.400%全取1億
財政	▲6,300		+3,500		+4,000		+3,000		
過不足	▲5,300		+3,800		+4,000		+4,000		
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	エンド	スタート	
国債買入		+4,800				+11,800			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,000		
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲100						
社債等買入									
ETF買入		+100		+200					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給					▲7,400	+9,000			
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲500		+3,900		+17,400		+3,000		
当座預金残高	2,090,500		2,094,400		2,111,800		2,114,800		
準備預金残高	1,912,700		1,912,700		1,912,700		1,912,700		
積み終了先	1,607,800		1,607,800		1,607,800		1,607,800		
超過準備	1,607,300		1,607,300		1,607,300		1,607,300		
非準備預金残高	177,800		177,800		177,800		177,800		
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		
平均	61.3%		61.3%		61.3%		61.3%		
乖離率	38.3%		38.3%		38.3%		38.3%		
共通担保(本店)			ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 8,000		
共通担保(全店)							68,307		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							46,753		
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

6/4以降の残り積み立て額(残り所要)積数 7,600

6/4以降の残り積み立て額(残り所要)平均 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%

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

6/2 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,032,600

6/2のコール市場残高(前日比)			
合計	200,882	+5,254	
有担	130,585	+1,222	
無担	70,297	+4,032	

*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	-	0.064	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.120	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.074	0.078	-	0.095	0.118	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.051	0.066	-	0.050	0.044	0.042	0.038	-	0.035	0.041	0.054

§ 6/4 オフア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分がロールされると予想。

6/4 の予定(国内)

8:50 前週の対外対内証券売買契約等の状況(財務省)
日銀開催の国際カンファレンスで黒田総裁挨拶

6/4 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
ル-DFRB理事の講演

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	+3,900	2,094,400	+2,094,400	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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	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	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	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	オフア額	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	6/4 ~ 6/11	担保範囲内	0	0	0.630%	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	5/29 ~ 6/4	担保範囲内	0	0	0.610%	固定金利	-	応札なし								
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