DAILY SIGNAL

平成27年6月4日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/4 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは161兆2000億円だった。
本日の無担保コールON物は0.075%の出会いから始まった。
その後は0.07~0.075%のレンジで出合が見られた。
後場に入ると調整程度の出合いが散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,612,000	+1,612,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/4 のオペ結果
	6/4(木)		6/5(金)		6/8(月)		6/9(火)		
券		+300		+0		+1,000		+1,000	9:20 ノオベ
財政		+3,600		+2,100		+3,000		▲1,000	10:40 CP等買入(6/9-)
過不足		+3,900		+2,100		+4,000		+0	0.085%(41.4%) 3,498億
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	11:50 国債補完供給(6/4-6/5)
国債買入				+11,800					▲0.400%全取 21億
国庫短期証券買入									12:50 ノオベ
国債買現先						▲1,000	+700		13:00 共通担保(全店)(固定金利方式)
共通担保(本店)									(6/8-9/7)
共通担保(全店)									0.10%(札割れ) 700億
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲600						
社債等買入			▲100						
ETF買入									
J-REIT買入		+200							
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			▲8,600	+9,000					
貸出増加支援									
当座預金増減		+4,000		+13,600		+3,700		+3,500	
当座預金残高		2,094,500		2,108,100		2,111,800		2,115,300	
準備預金残高		1,909,500							
積み終了先		1,604,800							共通担保(本店) 0
超過準備		1,604,700							共通担保(全店) 68,307
非準備先残高		185,000							国債買現先 0
準備預金進捗率		99.7%							CP買現先 0
平均		64.5%	予想込増減	+13,600	予想込増減	+3,700	予想込増減	+3,500	成長基盤強化 46,753
乖離率		35.2%	当預見込	2,108,100	当預見込	2,111,800	当預見込	2,115,300	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
6/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 5,900
6/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	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	0.070	0.020	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

6/3 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,031,100

(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
6/4	536(3M)	0.0020%	0.0012%
5/28	535(3M)	0.0040%	0.0012%
5/21	534(3M)	0.0040%	0.0012%

6/3 のコール市場残高(前日比)			
合計	有担	無担	
194,633	127,062	67,571	-6,249
			-3,523
			-2,726

*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	0.067	-	0.091	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.084	-	0.101	-	-	-	-	0.120	-	-
東京レボレート	0.053	0.075	-	0.050	0.044	0.042	0.037	-	0.035	0.041	0.054

§ 6/5 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は、0.07%台半ばで取引されよう。
共通担保オペは期落ちがなく、ノオベを予想。

6/5 の予定(国内)

14:00 4月の景気動向指数速報(内閣府)

6/5 の予定(海外)

米 5月雇用統計
NY連銀総裁の講演

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							
◎ ノオベ	+13,600	2,108,100	+2,108,100	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2015/6/8 ~ 2015/9/7	8,000	700	700	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
2015/6/2 ~ 2015/9/11	15,000	5,550	5,550	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
2015/6/1 ~ 2015/8/31	8,000	2,070	2,070	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率			
2015/5/29 ~ 2015/9/8	15,000	7,160	7,160	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								
2015/5/26 ~ 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																
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																

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