

DAILY SIGNAL

平成27年6月9日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは164兆7000億円だった。
本日の無担保コールON物は0.074%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。
後場に入るとビッドは薄くなり、0.07%近辺での出会いとなった。
また、地銀業態から試取りとみられる動きがあり、0.12%超での出合も見られた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,647,000	+1,647,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/9 のオペ結果
	6/9(火)		6/10(水)		6/11(木)		6/12(金)		
券	+700		+400		▲1,000		▲1,000		9:20
財政	+2,200		▲11,800		▲3,000		▲1,000		ノーオペ
過不足	+2,900		▲11,400		▲4,000		▲2,000		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	ノーオペ
国債買入		+11,700							10:40
国庫短期証券買入		+5,000							米ドル資金供給
国債買現先									(6/11-6/18)
共通担保(本店)									利率0.640% 1百万米ドル
共通担保(全店)									11:50
CP買現先									国債補充供給(6/9-6/10)
CP等買入	▲100	+3,500	▲1,300						▲0.400%全取 98億
社債等買入			▲100						12:50
ETF買入									ノーオペ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:50
国債補充供給		▲100	+100						国債補充供給(6/9-6/10)
成長基盤強化支援									▲0.400%全取 2億
貸出増加支援									
当座預金増減	+22,900		▲12,700		▲4,000		▲2,000		
当座預金残高	2,130,400		2,117,700		2,113,700		2,111,700		
準備預金残高	1,943,500		1,943,500		1,943,500		1,943,500		
積み終了先	1,642,700		1,642,700		1,642,700		1,642,700		共通担保(本店) 0
超過準備	1,642,700		1,642,700		1,642,700		1,642,700		共通担保(全店) 68,017
非準備預金残高	186,900		186,900		186,900		186,900		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先 0
平均	80.6%		80.6%		80.6%		80.6%		成長基盤強化 48,366
乖離率	19.3%		19.3%		19.3%		19.3%		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) 2,060,700
6/10 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 1,000
6/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	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	0.060
ビッド	0.070	0.020	0.100	0.075
出来値	-	-	-	-

6/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,046,500

(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
6/8	537(6M)	-0.0039%	-0.0079%
6/4	536(3M)	0.0020%	0.0012%
5/28	535(3M)	0.0040%	0.0012%

6/8 のコール市場残高(前日比)			
合計	有担	無担	
199,519	+372	130,012	-456
69,507	+828		

*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	0.071	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.122	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.074	0.086	-	0.200	0.142	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.052	0.070	-	0.051	0.043	0.039	0.037	-	0.035	0.041	0.054

§ 6/10 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いため、ノーオペを予想する。

6/10 の予定(国内)

佐藤日銀審議委員が山梨県で挨拶
4月の機械受注(内閣府)
5月の企業物価指数(日銀)

6/10 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数

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	▲12,700	2,117,700	+2,117,700	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										
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
2015/6/2 ~ 2015/9/11	15,000	5,550	5,550	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
2015/6/1 ~ 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
2015/5/29 ~ 2015/9/8	15,000	7,160	7,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/5/26 ~ 2015/9/4	15,000	7,210	7,210	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/5/25 ~ 2015/8/24	8,000	2,840	2,840	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2015/5/22 ~ 2015/9/1	15,000	7,256	7,256	0.10%	固定金利	-	札割れ	6/11 ~ 6/18	担保範囲内	1	1	0.640%	固定金利	-	1.00
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	-	応札なし

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