

DAILY SIGNAL

平成27年6月10日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

6/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは162兆円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.075~0.077%で取引され、
その後は0.07%前半半での取引となった。
後場に入るとビッドは薄くなり0.07%割れの出合いも見られた。
また、朝方から証券業態から試取りとみられる動きがあり、0.12%超でも大きく出合った。

(単位: 億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,620,000	+1,620,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/10 のオペ結果
	6/10(水)		6/11(木)		6/12(金)		6/15(月)		
券	+300		▲700		▲1,000		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(6/12-) (残存1年以下) +0.007%按分(49.1%) 705億 (残存5年超10年以下) +0.036%按分(39.6%) 4,005億 10:40 社債等買入(6/16-) 0.052%(61.1%) 1,100億 11:50 国債補完供給(6/10-6/11) ▲0.400%全取 104億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲11,500		+700		▲1,000		+85,000		
過不足	▲11,200		+0		▲2,000		+86,000		
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					+4,700				
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)									
CP買現先									
CP等買入	▲1,300		▲200						
社債等買入	▲100								
ETF買入				+200					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+100	▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲12,600		+100		+2,700		+86,000		
当座預金残高	2,117,800		2,117,900		2,120,600		2,206,600		
準備預金残高	1,921,800		1,622,800		1,622,800		1,622,300		
積み終了先	1,622,800		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	1,622,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備預金残高	196,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	83.9%		予想込増減 +100		予想込増減 +2,700		予想込増減 +86,000		
乖離率	16.0%		当預見込 2,117,900		当預見込 2,120,600		当預見込 2,206,600		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,026,700
6/11 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 400
6/11 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 100

	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	0.075
ビッド	0.070	0.020	0.100	0.085
出来値	-	0.020	-	-

6/9 時点のマネタリーベース(単位: 億円) 3,068,700

(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%

6/9 のコール市場残高(前日比)			
合計	199,928	+409	
有担	130,706	+694	
無担	69,222	-285	

*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	0.072	-	0.064	0.130	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	0.140	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.089	0.083	-	0.100	0.202	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.050	0.057	-	0.048	0.043	0.038	0.037	-	0.035	0.041	0.054

6/11 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、ノオベを予想する。

6/11 の予定(国内)

8:50 対外対内証券売買契約等の状況(財務省)
4-6月の法人企業景気予測調査(財務省・内閣府)

6/11 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
5月の小売売上高

16:00 5月の投信概況(投信協会)

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								
◎	ノオベ	+100	2,117,900	+2,117,900	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				
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