

DAILY SIGNAL

平成27年6月11日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/11 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは163兆5000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%で出会い始め、
その後は0.075%近辺で取引された。後場に入るとビッドは
薄くなり0.07%近辺での取引となった。
ターム物は1W物で0.11%台後半の出会いがみられた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,635,000	+1,635,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/11 のオペ結果
	6/11(木)		6/12(金)		6/15(月)		6/16(火)		
券	▲800		▲1,000		+1,000		+0		9:20
財政	+200		▲200		+85,000		+0		ノオベ
過不足	▲600		▲1,200		+86,000		+0		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	ノオベ
国債買入				+4,700					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(6/11-6/12)
国債買現先									▲0.400%全取 121億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)									ノオベ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲600						ノオベ
社債等買入			▲200						
ETF買入		+200		+200				+1,100	
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	▲600		+3,000		+86,000		+1,100		
当座預金残高	2,117,200		2,120,200		2,206,200		2,207,300		
準備預金残高	1,930,900		1,633,100		共通担保オペ当社予想		共通担保(本店)		0
積み終了先	1,633,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 68,017
超過準備	1,633,100								国債買現先 0
非準備先残高	186,300								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化 48,366
平均	87.1%		予想込増減 +3,000		予想込増減 +86,000		予想込増減 +1,100		被災地金融機関支援 3,244
乖離率	12.8%		当預見込 2,120,200		当預見込 2,206,200		当預見込 2,207,300		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,026,800

6/12 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 300

6/12 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
オフア	0.120	0.080	0.060	0.075
ビッド	0.070	0.020	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

6/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,055,700

(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
6/11	538(3M)	0.0020%	0.0004%
6/8	537(6M)	-0.0039%	-0.0079%
6/4	536(3M)	0.0020%	0.0012%

6/10 のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
209,979	130,832	79,147
+10,051	+126	+9,925

*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	0.072	-	0.117	0.114	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.120	-	0.175	0.170	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.074	0.082	-	0.118	0.123	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.053	0.090	-	0.053	0.048	0.038	0.038	-	0.035	0.041	0.054

§ 6/12 オフア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。

6/12 の予定(国内)

10:00 6/10現在の営業毎旬報告(日銀)
13:30 4月の鉱工業生産確報(経産省)

6/12 の予定(海外)

米 5月の生産者物価
6月シガン大学消費者信頼感速報

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	+3,000	2,120,200	+2,120,200	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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート
2015/6/8 ~ 2015/9/7	8,000	700	700	0.10%	固定金利	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%
2015/6/2 ~ 2015/9/11	15,000	5,550	5,550	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%
2015/6/1 ~ 2015/8/31	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%
2015/5/29 ~ 2015/9/8	15,000	7,160	7,160	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%
2015/5/26 ~ 2015/9/4	15,000	7,210	7,210	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%
2015/5/25 ~ 2015/8/24	8,000	2,840	2,840	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%
2015/5/22 ~ 2015/9/1	15,000	7,256	7,256	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%
2015/5/19 ~ 2015/8/28	15,000	11,251	11,251	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%

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