

DAILY SIGNAL

平成27年6月12日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/12 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0.077%で出会い始め、
その後も同水準で取引される堅調な地合いとなった。
後場に入ると0.07%台前半での出会いが散見されて引けた。
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	オフー額	準備残高見込	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				6/12 のオペ結果
	6/12(金)		6/15(月)		6/16(火)		6/17(水)		
券	▲1,000		+600		+0		+0		9:20
財政	+0		+79,200		+0		+4,000		ノーオペ
過不足	▲1,000		+79,800		+0		+4,000		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	国庫短期証券買入(6/16-)
国債買入	+4,700				+11,600				+0.006%按分 全取 10,000億
国庫短期証券買入					+10,000				国債買入(6/16-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)									+0.005%按分(27.6%) 3,752億
共通担保(全店)									(残存3年超5年以下)
CP買現先									▲0.015%按分(54.6%) 4,008億
CP等買入	▲600		▲400						(残存10年超25年以下)
社債等買入	▲200		▲100						▲0.029%按分(39.7%) 2,402億
ETF買入									(残存25年超)
J-REIT買入		+200		+300					▲0.019%按分(100.0%)1,401億
被災地金融機関支援貸出									11:50
国債補完供給	+100	▲200	+200						国債補完供給(6/12-6/15)
成長基盤強化支援貸出増加支援									▲0.400%全取 155億
当座預金増減	+3,000		+79,800		+22,700		+4,000		12:50
当座預金残高	2,120,200		2,200,000		2,222,700		2,226,700		ノーオペ
準備預金残高	1,943,300		1,645,300		1,645,300		1,645,300		13:00
積み終了先	1,645,300		1,645,300		1,645,300		1,645,300		ノーオペ
超過準備	1,645,300		1,645,300		1,645,300		1,645,300		共通担保(本店)
非準備先残高	176,900		176,900		176,900		176,900		共通担保(全店)
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		国債買現先
平均	96.8%		96.8%		96.8%		96.8%		CP買現先
乖離率	3.2%		3.2%		3.2%		3.2%		成長基盤強化
			予想込増減	+79,800	予想込増減	+22,700	予想込増減	+4,000	被災地金融機関支援
			当預見込	2,200,000	当預見込	2,222,700	当預見込	2,226,700	ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,026,800

6/15 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 0

6/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

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

6/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,055,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	6/10
長期国債	142	202	241
CP等	2.2	2.2	2.4
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	50
その他とも資産計	224	300	345
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	212
その他とも負債・純資産計	224	300	345

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%

6/11 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	201,603	-8,376	
	131,780	+948	
	69,823	-9,324	

*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	0.030	0.072	-	0.116	0.115	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.120	-	0.117	0.118	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.074	0.080	-	0.117	0.116	-	0.145	-	-	-	-
東京レボレート	0.062	0.089	-	0.053	0.048	0.038	0.038	-	0.035	0.042	0.054

§ 6/15 オフ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。

6/15 の予定(国内)

6月の月例経済報告(内閣府)

6/15 の予定(海外)

米 6月のNY連銀製造業景況感指数

5月の鉱工業生産

6月のNAHB住宅市場指数

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	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	+79,800	2,200,000	+2,200,000	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	-	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