

DAILY SIGNAL

平成27年6月16日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは171兆5,000億円。
無担保コールON物は朝方0.075%の出しから始まり、
その後は0.07~0.076%のレンジで推移した。
後場からは0.07%近辺の取引が散見され、引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,715,000	+1,706,707

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/16 のオペ結果
	6/16(火)		6/17(水)		6/18(木)		6/19(金)		
券	+200		▲800		▲2,000		▲2,000		9:20 ノオベ 10:40 米ドル資金供給(6/18-6/25) 利率0.640% 0百万米ドル CP等買入(6/19-) 0.087%按分(40.8%) 3,495億 11:50 国債補完供給(6/16-6/17) ▲0.400%全取 186億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+5,900		+1,300		+1,000		+1,000		
過不足	+6,100		+500		▲1,000		▲1,000		
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		+11,600							
国庫短期証券買入		+10,000							
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先	▲600		▲200					+3,500	
CP等買入		+1,100		+200					
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+400	▲200	+200					▲200	
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+28,400		+700		▲1,000		+2,300		
当座預金残高	2,226,900		2,227,600		2,226,600		2,228,900		
準備預金残高	2,031,600		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	574,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	440,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備預金残高	195,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	64.9%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	3.3%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
乖離率	61.6%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
予想込増減	+700		+700		▲1,000		+2,300		
当預見込	2,227,600		2,227,600		2,226,600		2,228,900		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							68,017		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							48,366		
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) 1,955,500

6/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 686,200

6/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 23,700

	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	0.070
出来値	-	-	-	-

6/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,137,800

(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%

6/15 のコール市場残高(前日比)		
合計	203,888	+3,692
有担	131,354	+2,469
無担	72,534	+1,223

*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	-	0.092	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.340	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.075	-	0.131	0.180	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.051	0.068	-	0.052	0.040	0.037	0.038	-	0.036	0.043	0.054

§ 6/17 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は朝方0.075%近辺で取引されると予想する。
共通担保オペの実施は見送られると予想する。

6/17 の予定(国内)

6/17 の予定(海外)

米 FOMC結果公表
イエレンFRB議長の見会
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	+700	2,227,600	+2,227,600	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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	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	按分率	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	6/18 ~ 6/25	担保範囲内	0	0	0.640%	固定金利	-	応札なし				
2015/5/19 ~ 2015/8/28	15,000	11,251	11,251	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				

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