

DAILY SIGNAL

平成27年6月18日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは171兆3,000億円。
無担保コールON物は朝方0.07%前半の取引からスタートした。
一部0.07%後半の出会いも散見され、前場終了。
後場からは0.07%前後で推移し、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	-	-	1,713,000	+1,713,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/18 のオペ結果
	6/18(木)		6/19(金)		6/22(月)		6/23(火)		
券	▲1,800		▲1,800		+0		▲1,000		9:20
財政	+1,700		+500		+19,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲100		▲1,300		+19,000		+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	ノーオペ
国債買入									11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(6/18-6/19)
国債買現先									▲0.400% 229億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲1,100	+1,100			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲300		▲400	+3,500					共通担保(全店)(固定金利方式)
社債等買入			▲600	+300					(6/22-9/24)
ETF買入		+200							0.10%(札割れ) 1,132億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲200	+200						
成長基盤強化支援			▲13,900	+21,600					
貸出増加支援									
当座預金増減	▲200		+9,400		+30,800		+0		
当座預金残高	2,227,200		2,236,600		2,267,400		2,267,400		
準備預金残高	2,032,600		2,032,600		2,032,600		2,032,600		
積み終了先	1,662,800		1,662,800		1,662,800		1,662,800		共通担保(本店) 0
超過準備	1,626,700		1,626,700		1,626,700		1,626,700		共通担保(全店) 68,017
非準備先残高	194,600		194,600		194,600		194,600		国債買現先 0
準備預金進捗率	94.6%		94.6%		94.6%		94.6%		CP買現先 0
平均	10.0%		10.0%		10.0%		10.0%		成長基盤強化 48,366
乖離率	84.6%		84.6%		84.6%		84.6%		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
6/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 105,700
6/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 3,900

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.060	0.060	0.075
ビッド	0.072	0.020	0.100	0.085
出来値	-	-	-	-

6/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,167,300**

(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
6/18	540(3M)	0.0019%	0.0000%
6/17	539(1Y)	-0.0100%	-0.0150%
6/11	538(3M)	0.0020%	0.0004%

6/17 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	196,955	-2,124	
	126,961	-3,265	
	69,994	+1,141	

*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	-	-	-	-	0.145	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	-	-	-	0.280	-	-	-	-
加重平均	0.074	0.079	-	0.075	-	-	0.169	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.049	0.060	-	0.053	0.040	0.039	0.039	-	0.036	0.043	0.054

§ 6/19 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は朝方0.07%台半ばの出会いか。
共通担保オペの実施は見送られよう。

6/19 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合の結果発表
黒田日銀総裁記者会見

6/19 の予定(海外)

米 クーブランド連銀総裁講演

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	+9,400	2,236,600	+2,236,600	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				
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	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				
2015/6/8 ~ 2015/9/7	8,000	700	700	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				
2015/6/2 ~ 2015/9/11	15,000	5,550	5,550	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46				
2015/6/1 ~ 2015/8/31	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70				
2015/5/29 ~ 2015/9/8	15,000	7,160	7,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/5/26 ~ 2015/9/4	15,000	7,210	7,210	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				
2015/5/25 ~ 2015/8/24	8,000	2,840	2,840	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				
2015/5/22 ~ 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				

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