

# DAILY SIGNAL

平成27年6月24日(水)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 6/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは173兆6,000億円。  
本日の無担保コールON物は朝方0.075%の出合いから始まり、その後は0.071~0.076%で取引された。また、一部試し取りの動きから0.12%台の出合いが散見された。後場に入り、ビッド水準は低下し、0.07%近辺で出合いそのまま引けた。

(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	-	-	1,736,000	+1,736,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/24 のオペ結果
	6/24(水)		6/25(木)		6/26(金)		6/29(月)		
券	▲1,600		▲2,200		▲3,000		+0		9:20
財政	+1,000		+700		▲2,000		+5,000		ノーオペ
過不足	▲600		▲1,500		▲5,000		+5,000		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	国債買入(6/26-)
国債買入		+8,100				+11,800			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入		+10,000							+0.002%按分(31.1%) 3,752億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									+0.003%全取 4,000億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先	▲300		▲1,600						▲0.004%按分(74.0%) 4,008億
CP等買入			▲500						11:50
社債等買入									国債補完供給(6/24-6/25)
ETF買入									▲0.400% 489億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援					▲500	+500			ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+500	▲500	+500						ノーオペ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+17,200		▲3,100		+6,800		+5,000		
当座預金残高	2,276,500		2,273,400		2,280,200		2,285,200		
準備預金残高	2,073,300		2,073,300		2,073,300		2,073,300		
積み終了先	1,725,900		1,725,900		1,725,900		1,725,900		共通担保(本店) 0
超過準備	1,725,900		1,725,900		1,725,900		1,725,900		共通担保(全店) 68,058
非準備先残高	203,200		203,200		203,200		203,200		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.5%		99.5%		99.5%		99.5%		CP買現先 0
平均	30.0%		30.0%		30.0%		30.0%		成長基盤強化 48,366
乖離率	69.5%		69.5%		69.5%		69.5%		被災地金融機関支援 3,244
			予想込増減 ▲3,100	予想込増減 ▲3,100	予想込増減 +6,800	予想込増減 +6,800	予想込増減 +5,000	予想込増減 +5,000	ロンハート残高 0
			当預見込 2,273,400	当預見込 2,273,400	当預見込 2,280,200	当預見込 2,280,200	当預見込 2,285,200	当預見込 2,285,200	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,955,500

6/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 9,200

6/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	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	0.050
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.065
出来値	-	-	-	-

6/23 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,204,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	6/20
長期国債	142	202	242
CP等	2.2	2.2	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	5.3
J-REIT	0.14	0.18	0.22
貸出支援基金	9.2	25	29
国庫短期証券	40	49	51
その他とも資産計	224	300	348
銀行券	90	93	90
当座預金	107	178	224
その他とも負債・純資産計	224	300	348

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%

6/23 のコール市場残高(前日比)

合計	201,522	-186
有担	131,674	+95
無担	69,848	-281

\*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	-	0.069	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.180	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.079	-	0.107	0.105	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.044	0.050	-	0.041	0.042	0.040	0.040	-	0.038	0.043	0.054

## § 6/25 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は引き続き0.07%台半ばで取引されるだろう。  
共通担保オペはノーオペを予想する。

## 6/25 の予定(国内)

8:50 対外及び対内証券売買契約等の状況 (財務省)

## 6/25 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数  
欧 EU首脳会議(ブリュッセル、26日まで)

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								
◎	ノーオペ	▲3,100	2,273,400	+2,273,400	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	6/25 ~ 7/2	担保範囲内	520	520	0.630%	固定金利	-	1.00				
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				

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