

§ 6/25 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは172兆円。
本日の無担保コールON物は朝方0.07%台半ばの出会いから始まり、その後も
同水準で推移した。調達一巡後はビッド水準が低下し、0.07%台前半の取引
となった。後場に入っても地合いに変化はなく調整程度の出合いが散見され引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,720,000	+1,720,000

(単位:億円)

日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/25 のオペ結果	
6/25(木)		6/26(金)		6/29(月)		6/30(火)			
券	▲2,400		▲2,300	+0		+0		9:20 ノーオペ	
財政	▲300		+3,400	+5,000		+2,000		10:10 ノーオペ	
過不足	▲2,700		+1,100	+5,000		+2,000		10:40 CP等買入(6/30-) 0.080%(32.5%) 3,985億	
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	11:50 国債補完供給(6/25-6/26) ▲0.400%全取 142億	
国債買入				+11,800				12:50 ノーオペ	
国庫短期証券買入								13:00 ノーオペ	
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲1,600		▲600			▲7,600	+4,000		
社債等買入	▲500			+500					
ETF買入				+500					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出			▲500	+500					
国債補完供給	+500	▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲4,400		+12,900		+5,000		▲1,600		
当座預金残高	2,272,100		2,285,000		2,290,000		2,288,400		
準備預金残高	2,065,700		共通担保オペ当社予想						共通担保(本店) 0
積み終了先	1,716,900		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 15,000	共通担保(全店) 68,058	
超過準備	1,716,400							国債買現先 0	
非準備預金残高	206,400							CP買現先 0	
準備預金進捗率	99.6%							成長基盤強化 48,366	
平均	33.3%		予想込増減 +12,900		予想込増減 +5,000		予想込増減 +13,400	被災地金融機関支援 3,244	
乖離率	66.3%		当預見込 2,285,000		当預見込 2,290,000		当預見込 2,303,400	ロンバート残高 0	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,955,500
6/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,000
6/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	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	0.060
ビッド	0.075	0.020	0.100	0.070
出来値	-	-	-	-

6/24 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,222,900

(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
6/25	541(3M)	0.0000%	-0.0012%
6/18	540(3M)	0.0019%	0.0000%
6/17	539(1Y)	-0.0100%	-0.0150%

6/24 のコール市場残高(前日比)

合計	198,992	-2,530
有担	129,997	-1,677
無担	68,995	-853

*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	0.068	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.088	-	-	0.117	-	0.260	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.043	0.052	-	0.036	0.040	0.040	0.040	-	0.038	0.043	0.054

§ 6/26 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台半ばでの出会いが中心となる。
共通担保オペは1兆5000億円オファーされると予想する。

6/26 の予定(国内)

8:30 5月有効求人倍率(厚労省)
5月完全失業率(総務省)
CPI(5月全国、6月中旬東京都区部)(総務省)

6/26 の予定(海外)

米 6月シガン大学消費者信頼感確報

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
◎ ノーオペ	+12,900	2,285,000	+2,285,000	0.050	0.070	0.070	0.075	0.075	0.117	0.118
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.125	0.150	0.150

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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	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	2012/6/1 ~ 2012/6/15		10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70					
2015/6/8 ~ 2015/9/7		8,000	700	700	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26		8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70					
2015/6/2 ~ 2015/9/11		15,000	5,550	5,550	0.10%	固定金利	-	札割れ																							
2015/6/1 ~ 2015/8/31		8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ																							
2015/5/29 ~ 2015/9/8		15,000	7,160	7,160	0.10%	固定金利	-	札割れ																							
2015/5/26 ~ 2015/9/4		15,000	7,210	7,210	0.10%	固定金利	-	札割れ																							
2015/5/25 ~ 2015/8/24		8,000	2,840	2,840	0.10%	固定金利	-	札割れ																							
2015/5/22 ~ 2015/9/1		15,000	7,256	7,256	0.10%	固定金利	-	札割れ																							

米ドル資金供給オペ								
期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
6/25 ~ 7/2		担保範囲内	520	520	0.630%	固定金利	-	1.00
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ありません。今後予告なく変更されることがあります。