DAILY SIGNAL

平成27年6月26日(金)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 6/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは173兆4,000億円。
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、その後も0.07%台半ばで推移した。後場に入り、一部調整程度の出合いが散見され引けた。
本日実施された共通担保オペ(6/30-10/9、オファー額1兆5,000億円)の応札額は733億円となり、期落ち分から約7,000億円減額となった。

	即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
8:00	-	-	1,734,000	+1,734,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想			
	6/26(金)		6/29(月)		6/30(火)		7/1(水)	
券	▲2,300		▲700		+0		+0	
財政	+3,500		▲100		+2,000		▲2,000	
過不足	+1,200		▲800		+2,000		▲2,000	
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		+11,800				+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)					▲7,600	+700		
CP買現先								
CP等買入	▲600		▲400			+4,000		
社債等買入								
ETF買入		+500		+100				
J-REIT買入								
被災地金融機関支援貸出	▲500	+500						
国債補完供給	+100							
成長基盤強化支援								
貸出増加支援								
当座預金増減	+13,000		▲1,100		+20,700		▲2,000	
当座預金残高	2,285,100		2,284,000		2,304,700		2,302,700	
準備預金残高	2,078,600		共通担保オペ当社予想					
積み終了先	1,732,900		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ	
超過準備	1,731,800							
非準預先残高	206,500							
準備預金進捗率	99.8%							
平均	43.3%		予想込増減	▲1,100	予想込増減	+20,700	予想込増減	▲2,000
乖離率	56.5%		当預見込	2,284,000	当預見込	2,304,700	当預見込	2,302,700

6/26 のオペ結果

9:20
ノーオペ
10:10
国庫短期証券買入(6/30-)
+0.000%按分(5.1%) 10,005億
国債買入(6/30-)
(残存1年超3年以下)
▲0.013%按分(18.0%) 3,752億
(残存3年超5年以下)
+0.007%全取 4,000億
(残存10年超25年以下)
▲0.003%按分(18.3%) 2,402億
(残存25年超)
▲0.002%按分(2.6%) 1,402億
11:50
国債補完供給(6/26-6/29)
▲0.400%全取 0億

12:50
ノーオペ
13:00
共通担保(全店)〈固定金利方式〉
(6/30-10/9)
0.10%(札割れ) 733億

共通担保(本店)	0
共通担保(全店)	68,058
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	3,241
ロンバート残高	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,955,800
6/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,000
6/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オファー	0.120	0.060	0.060	▲0.10
ビッド	0.070	0.020	0.100	0.001
出来値	-	-	-	-

6/25 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,220,900

(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%

6/25 のコール市場残高(前日比)

合計	198,210	-782
有担	129,459	-538
無担	68,751	-244

*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	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.078	-	0.180	0.145	-	-	-	0.200	-	-
東京レポ・レート	0.043	0.066	-	0.029	0.036	0.039	0.038	-	0.038	0.043	0.054

§ 6/29 オファーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は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。

6/29 の予定(国内)
8:50 5月の鉱工業生産・速報(経産省)

6/29 の予定(海外)
米 5月の中古住宅販売仮契約

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	▲1,100	2,284,000	+2,284,000	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

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
2015/6/30 ～ 2015/10/9	15,000	733	733	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/6/22 ～ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/6/8 ～ 2015/9/7	8,000	700	700	0.10%	固定金利	-	札割れ
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

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
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
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

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