

DAILY SIGNAL

平成27年6月29日(月)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは173兆円。
本日の無担保コールON物は朝方0.07%の出会いから始まり、その後は
0.065~0.068%で推移した。一巡後はビッドが薄くなったものの、出会いのレンジは
同水準で取引された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,730,000	+1,730,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/29 のオペ結果
	6/29(月)		6/30(火)		7/1(水)		7/2(木)		
券	▲900		+100		+0		+0		9:20
財政	▲500		+1,400		▲2,000		▲30,000		ノーオペ
過不足	▲1,400		+1,500		▲2,000		▲30,000		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(7/1-)
国債買入				+11,900		+5,400			(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入				+10,000					▲0.024%(全取) 4000億
国債買現先									(変動利付債)
共通担保(本店)			▲7,600	+700					▲0.320円按分(65.5%)1402億
共通担保(全店)									11:50
CP買現先									国債補完供給(6/29-6/30)
CP等買入	▲400		▲4,800	+4,000					▲0.400%(全取) 214億
社債等買入									12:50
ETF買入		+100		+200					ノーオペ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									
国債補完供給		▲200	+200						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲1,900		+16,100		+3,400		▲30,000		
当座預金残高	2,283,200		2,299,300		2,302,700		2,272,700		
準備預金残高	2,077,100		1,730,600		1,730,600		1,730,600		共通担保(本店) 0
積み終り先	1,730,600		1,730,600		1,730,600		1,730,600		共通担保(全店) 68,058
超過準備	1,730,600		1,730,600		1,730,600		1,730,600		国債買現先 0
非準備預金残高	206,100		206,100		206,100		206,100		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化 48,366
平均	46.7%		46.7%		46.7%		46.7%		被災地金融機関支援 3,241
乖離率	53.2%		53.2%		53.2%		53.2%		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,955,800

6/30 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 2,700

6/30 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	レボG.C
オファー	0.030	-	0.060	0.025
ビッド	0.005	-	0.100	0.040
出来値	-	-	-	-

6/26 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,236,200

(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%

6/26 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	196,605	-1,605	-
	128,926	-533	-
	67,679	-1,072	-

*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	0.005	-	-	-	-	0.175	-	-	-	-
最高	0.125	0.128	-	-	-	-	0.180	-	-	-	-
加重平均	0.072	0.016	-	-	0.118	-	0.178	-	-	-	-
東京レボレート	0.039	▲0.085	-	0.038	0.038	0.039	0.040	-	0.036	0.042	0.053

§ 6/30 オファターのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.001~0.03%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。

6/30 の予定(国内)

8:50 5月末の国内銀行の資産・負債等

6/30 の予定(海外)

米 6月の消費者信頼感
(銀行勘定、日銀) キリヤ IMFへの支払期限、2次支援終了期限

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	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	+16,100	2,299,300	+2,299,300	0.001	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
2015/6/30 ~ 2015/10/9	15,000	733	733	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
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	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
2015/6/8 ~ 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
2015/6/2 ~ 2015/9/11	15,000	5,550	5,550	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
2015/6/1 ~ 2015/8/31	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/5/29 ~ 2015/9/8	15,000	7,160	7,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	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
2015/5/26 ~ 2015/9/4	15,000	7,210	7,210	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
2015/5/25 ~ 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

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。 上田八木証券株式会社 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