

DAILY SIGNAL

平成27年7月1日(水)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは174兆7000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.05%の出会いから始まり、その後は一時0.065%まで上昇した。一巡後は0.06%を中心に取引され、後場にかけて0.05%近辺で調整の出会いが散見され引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,747,000	+1,747,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/1 のオペ結果
	7/1(水)		7/2(木)		7/3(金)		7/6(月)		
券	▲600		▲600		+0		+1,000		9:20
財政	▲5,500		▲30,900		+2,000		▲21,000		ノーオペ
過不足	▲6,100		▲31,500		+2,000		▲20,000		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(7/3-)
国債買入		+5,600				+8,700			(残存1年以下)
国庫短期証券買入									+0.006%按分(88.8%) 708億
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)									0.000%按分(38.5%) 3755億
共通担保(全店)					▲3,900	+9,100	▲2,300		(残存3年超5年以下)
CP買現先									+0.008%按分(15.4%) 4255億
CP等買入			▲100						11:50
社債等買入									国債補完供給(7/1-7/2)
ETF買入		+100		+100					▲0.400% 221億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+800	▲200	+200						共通担保(全店)(固定金利方式)
成長基盤強化支援									(7/3-10/14)
貸出増加支援									0.10%(札割れ) 9100億
当座預金増減	+200		▲31,300		+15,900		▲22,300		
当座預金残高	2,298,600		2,267,300		2,283,200		2,260,900		
準備預金残高	2,084,900								
積み終了先	1,743,300								共通担保(本店) 0
超過準備	1,743,300								共通担保(全店) 61,199
非準備先残高	213,700								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	53.3%		予想込増減 ▲31,300		予想込増減 +15,900		予想込増減 ▲14,300		成長基盤強化 48,366
乖離率	46.6%		当預見込 2,267,300		当預見込 2,283,200		当預見込 2,268,900		被災地金融機関支援 3,241
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,953,900
7/2以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,900
7/2以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	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	0.055
ビッド	0.065	0.010	0.100	0.065
出来値	-	-	-	-

6/30時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,250,500

(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%

6/30のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	199,904	145,221	54,683
	+9,505	+11,754	-2,249

*出所:営業毎報告
*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	0.020	0.050	-	0.059	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.122	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.062	0.066	-	0.103	0.118	-	0.170	-	-	-	-
東京レボレート	0.016	0.045	-	0.041	0.041	0.040	0.040	-	0.036	0.042	0.053

§ 7/2 オファターのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.06~0.065%で取引されるだろう。
共通担保オペは期落ちをロールするだろう。

7/2の予定(国内)

8:50 6月調査の短観全容・企業物価見通し(日銀)
6月のマネタリーベース(日銀)
10:00 6月30日現在の営業毎報告(日銀)

7/2の予定(海外)

米 6月の雇用統計
5月の製造業受注指数

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	▲31,300	2,267,300	+2,267,300	0.050	0.060	0.060	0.060	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	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	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
2015/6/30 ~ 2015/10/9	15,000	733	733	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
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	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	按分レド	平均レド	按分率	倍率		
2015/6/8 ~ 2015/9/7	8,000	700	700	0.10%	固定金利	-	札割れ	6/30 ~ 7/1	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし	6/25 ~ 7/2	担保範囲内	520	520	0.630%	固定金利	-	1.00
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																

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