

DAILY SIGNAL

平成27年7月3日(金)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは173兆7000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.074%の出会いから始まり、その後は
0.07~0.075%を中心に取引された。一巡後はビッドが徐々に消え、
0.069~0.07%で推移し、後場にかけて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	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,737,000	+1,737,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/3 のオペ結果
	7/3(金)		7/6(月)		7/7(火)		7/8(水)		
券	▲700		+1,300		+1,000		+0		9:20
財政	+5,400		▲22,300		+1,000		▲2,000		ノーオペ
過不足	+4,700		▲21,000		+2,000		▲2,000		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	国庫短期証券買入(7/7-)
国債買入		+8,700				+7,800			-0.014%按分(69.3%) 17501億
国庫短期証券買入						+17,500			国債買入(7/7-)
国債買現先									(残存5年超10年以下)
共通担保(本店)	▲3,900	+9,100	▲2,300	+1,800					-0.026%按分(60.0%) 4000億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先									-0.022%按分(99.3%) 2402億
CP等買入	▲400		▲300						(残存25年超)
社債等買入									-0.024%按分(22.6%) 1406億
ETF買入		+200		+200					
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(7/3-7/6)
貸出									▲0.400% 20億
国債補完供給	+100								13:00
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									
当座預金増減	+18,500		▲21,600		+27,300		▲2,000		
当座預金残高	2,286,800		2,265,200		2,292,500		2,290,500		
準備預金残高	2,070,400		1,729,400		1,729,400		1,729,400		共通担保(本店)
積み終了先	1,729,400		1,729,400		1,729,400		1,729,400		共通担保(全店)
超過準備	1,729,400		1,729,400		1,729,400		1,729,400		国債買現先
非準備先残高	216,400		216,400		216,400		216,400		CP買現先
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化
平均	66.7%		66.7%		66.7%		66.7%		被災地金融機関支援
乖離率	33.2%		33.2%		33.2%		33.2%		ロンハート残高
			予想込増減	▲21,600	予想込増減	+27,300	予想込増減	▲2,000	0
			当預見込	2,265,200	当預見込	2,292,500	当預見込	2,290,500	66,399

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,953,900
7/6以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,000
7/6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	0.010
ビッド	0.074	-	0.100	0.020
出来値	-	-	-	-

7/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,221,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	6/30
長期国債	142	202	241
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	2.5	3.8	5.4
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	50
その他とも資産計	224	300	345
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	230
その他とも負債・純資産計	224	300	345

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
7/2	542(3M)	0.0000%	-0.0024%
6/25	541(3M)	0.0000%	-0.0012%
6/18	540(3M)	0.0019%	0.0000%

7/2 のコール市場残高(前日比)

	合計	195,342	-734
有担	131,169	-1,963	
無担	64,173	+1,229	

*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	0.069	-	-	0.140	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.120	-	-	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.076	-	-	0.168	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.033	0.038	-	0.042	0.041	0.040	0.040	-	0.036	0.041	0.053

§ 7/6 オファターのオペと市場動向予想

週初の足許金利は0.065~0.075%で
取引されるだろう。共通担保オペはノーオペ予想。

7/6 の予定(国内)

14:00 5月の景気動向指数速報(内閣府)

地域経済報告(日銀)

未定 日銀支店長会議(黒田日銀総裁あいさつ)

7/6 の予定(海外)

米 6月のISM非製造業指数

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	▲21,600	2,265,200	+2,265,200	0.070	0.070	0.070	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		
2015/7/6 ~ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	0.10%	固定金利	-	札割れ		
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		

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		
6/30 ~ 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		

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。 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