

DAILY SIGNAL

平成27年7月6日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは171兆1000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.073%の出会いから始まり、その後は0.07%台半ばで取引された。後場に入ると調整程度のお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	-	-	1,711,000	+1,711,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/6 のオペ結果
	7/6(月)		7/7(火)		7/8(水)		7/9(木)		
券	+1,100		+700		+0		+0		9:20
財政	▲22,800		+300		▲2,000		▲5,000		ノーオペ
過不足	▲21,700		+1,000		▲2,000		▲5,000		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	ノーオペ
国債買入				+8,200					11:50
国庫短期証券買入				+17,500					国債補完供給(7/6-7/7)
国債買現先									0億
共通担保(本店)	▲2,300	+1,800							12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先			▲300						13:00
CP等買入	▲300								ノーオペ
社債等買入									13:50
ETF買入		+200		+300					国債補完供給(7/6-7/7)
J-REIT買入									▲0.400% 20億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給									
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲22,300		+26,700		▲2,000		▲5,000		
当座預金残高	2,264,500		2,291,200		2,289,200		2,284,200		
準備預金残高	2,049,300								
積み終了先	1,711,300		ノーオペ		共通担保オペ当社予想		ノーオペ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,711,300								共通担保(全店) 65,948
非準備先残高	215,200								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	70.0%		予想込増減	+26,700	予想込増減	▲2,000	予想込増減	▲5,000	成長基盤強化 48,366
乖離率	29.9%		当預見込	2,291,200	当預見込	2,289,200	当預見込	2,284,200	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

7/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 800

7/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

(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%

	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	0.005
ビッド	0.075	-	0.100	0.020
出来値	-	-	-	-

7/3 のコール市場残高(前日比)			
合計	197,082	+1,740	
有担	132,735	+1,566	
無担	64,347	+174	

7/3 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,240,700

*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	0.068	-	0.081	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.075	-	0.087	0.340	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	0.020	0.013	-	0.036	0.037	0.037	0.038	-	0.036	0.041	0.051

§ 7/7 オペのオペと市場動向予想

足許金利は0.07~0.075%で取引されるだろう。

共通担保オペはノーオペ予想。

7/7 の予定(国内)

特になし

7/7 の予定(海外)

米 5月の貿易収支

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	+26,700	2,291,200	+2,291,200	0.070	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					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
2015/7/6 ~ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	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
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/6/30 ~ 2015/10/9	15,000	733	733	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	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	7/2 ~ 7/9	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし
2015/6/8 ~ 2015/9/7	8,000	700	700	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								
2015/6/2 ~ 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																

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