

DAILY SIGNAL

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

§ 7/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは174兆1000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.074%の出合から始まり、その後は
0.07~0.075%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが徐々に薄くなり、
そのまま引けた。また、一部で試取と見られる動きがあり、0.12%台での出合も見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,741,000	+1,741,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/7 のオペ結果
	7/7(火)		7/8(水)		7/9(木)		7/10(金)		
券	+800		+400		+0		+0		9:20
財政	▲200		+200		▲5,000		▲21,000		ノーオペ
過不足	+600		+600		▲5,000		▲21,000		10:40
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	米ドル資金供給(7/9-7/16)
国債買入		+8,200							利率0.630% 0百万米ドル
国庫短期証券買入		+17,500							CP等買入(7/10-)
国債買現先									0.083%按分(30.8%) 3985億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲300		▲100						ノーオペ
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入		+300							
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	+26,300		+500		▲5,000		▲17,000		
当座預金残高	2,290,800		2,291,300		2,286,300		2,269,300		
準備預金残高	2,067,800								
積み終了先	1,730,400								共通担保(本店) 0
超過準備	1,730,400								共通担保(全店) 65,948
非準備先残高	223,000								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	73.3%		予想込増減 +500		予想込増減 ▲5,000		予想込増減 ▲17,000		成長基盤強化 48,366
乖離率	26.6%		当預見込 2,291,300		当預見込 2,286,300		当預見込 2,269,300		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) 1,962,900

7/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 700

7/8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	0.005
ビッド	0.075	-	0.100	0.020
出来値	-	-	-	-

7/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,217,300

(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%

7/6 のコール市場残高(前日比)			
合計	196,471		-611
有担	131,606		-1,129
無担	64,865		+518

*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	0.020	0.069	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.200	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.076	-	0.165	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.011	0.008	-	0.033	0.035	0.035	0.035	-	0.035	0.040	0.050

§ 7/8 オファー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。

7/8 の予定(国内)

8:50 5月の国際収支(財務省)

6月の貸出・預金動向(日銀)

6月の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

7/8 の予定(海外)

米 MBA住宅ローン申請指数

6月16~17日のFOMC議事録

サンフランシスコ連銀総裁の講演

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	+500	2,291,300	+2,291,300	0.055	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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	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				
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	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				
2015/6/30 ~ 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				
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	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				
2015/6/8 ~ 2015/9/7	8,000	700	700	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/6/2 ~ 2015/9/11	15,000	5,550	5,550	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2015/6/1 ~ 2015/8/31	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ	7/9 ~ 7/16	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし				
2015/5/29 ~ 2015/9/8	15,000	7,160	7,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	7/2 ~ 7/9	担保範囲内	0	0	0.630%	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