

DAILY SIGNAL

平成27年7月8日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/8 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0.075%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。後場に入ると0.07%近辺で少額の出合が見られ、そのまま引けた。
本日実施された国庫短期証券(543回、6M)の入札結果は最高落札利回り(▲0.0156%)、平均落札利回り(▲0.0195%)ともに、6か月物として過去最低利回りとなった。

	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				7/8 のオペ結果
	7/8(水)		7/9(木)		7/10(金)		7/13(月)		
券	+400		+100		+0		+1,000		9:20
財政	+2,200		▲3,100		▲21,000		▲11,000		ノーオペ
過不足	+2,600		▲3,000		▲21,000		▲10,000		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(7/10-)
国債買入						+12,000			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									▲0.001%按分(53.0%) 3754億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.006%按分(73.7%) 4253億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.023%按分(49.9%) 4011億
CP等買入	▲100		▲400			+4,000			12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入				+200					13:00
J-REIT買入									ノーオペ
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	+2,500		▲3,200		▲5,000		▲11,000		
当座預金残高	2,293,300		2,290,100		2,285,100		2,274,100		
準備預金残高	2,070,900		2,070,900		2,070,900		2,070,900		
積み終了先	1,735,700		1,735,700		1,735,700		1,735,700		共通担保(本店) 0
超過準備	1,735,700		1,735,700		1,735,700		1,735,700		共通担保(全店) 65,948
非準備先残高	222,400		222,400		222,400		222,400		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先 0
平均	76.7%		76.7%		76.7%		76.7%		成長基盤強化 48,366
乖離率	23.2%		23.2%		23.2%		23.2%		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

7/9 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 500

7/9 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	0.055
ビッド	0.075	-	0.100	0.075
出来値	-	-	-	-

7/7 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,242,900

(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
7/8	543(6M)	-0.0156%	-0.0195%
7/2	542(3M)	0.0000%	-0.0024%
6/25	541(3M)	0.0000%	-0.0012%

7/7 のコール市場残高(前日比)			
合計	202,415	+5,944	
有担	131,241	-365	
無担	71,174	+6,309	

*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	-	0.064	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.170	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.075	-	0.097	0.140	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.010	0.017	-	0.034	0.036	0.035	0.036	-	0.035	0.040	0.050

§ 7/9 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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

7/9 の予定(国内)

8:50 5月の機械受注(内閣府)
6月のマネーストック(日銀)
前週の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

7/9 の予定(海外)

米 新規失業保険申請件数
ブレイクFRB理事の講演

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	▲3,200	2,290,100	+2,290,100	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	4,003	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