

DAILY SIGNAL

平成27年7月9日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは173兆4000億円だった。
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。調達一巡後はビッドが徐々に薄くなり、そのまま引けた。
本日実施された国庫短期証券(544回、3M)の入札結果は最高落札利回りが▲0.0059%と前回債(0.000%)に比べて低下し、3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	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,734,000	+1,734,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/9 のオペ結果
	7/9(木)		7/10(金)		7/13(月)		7/14(火)		
券	+0		▲200		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲2,900		▲20,700		▲11,000		▲24,000		ノーオペ
過不足	▲2,900		▲20,900		▲10,000		▲23,000		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				+12,100					11:50
国庫短期証券買入									国債補充供給(7/9-7/10)
国債買現先									0億
共通担保(本店)					▲1,000	+1,100			12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲400		▲500	+4,000					共通担保(全店)(固定金利方式)
社債等買入			▲100						(7/13-10/13)
ETF買入									0.10%(札割れ) 1050億
J-REIT買入		+200		+300					
被災地金融機関支援貸出									
国債補充供給									
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲3,100		▲5,100		▲9,900		▲23,000		
当座預金残高	2,290,200		2,285,100		2,275,200		2,252,200		
準備預金残高	2,069,500		1,734,800		1,734,800		1,734,800		共通担保(本店) 0
積み終了先	1,734,800		1,734,800		1,734,800		1,734,800		共通担保(全店) 65,948
超過準備	1,734,800		1,734,800		1,734,800		1,734,800		国債買現先 0
非準備預金残高	220,700		220,700		220,700		220,700		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化 48,366
平均	80.0%		80.0%		80.0%		80.0%		被災地金融機関支援 3,241
乖離率	19.9%		19.9%		19.9%		19.9%		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,962,900

7/10 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 400

7/10 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	0.050
ビッド	0.075	0.000	0.100	0.060
出来値	-	-	-	-

7/8 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,245,000

(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
7/9	544(3M)	-0.0059%	-0.0087%
7/8	543(6M)	-0.0156%	-0.0195%
7/2	542(3M)	0.0000%	-0.0024%

7/8 のコール市場残高(前日比)			
合計	204,952	+2,537	
有担	133,007	+1,766	
無担	71,945	+771	

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.090	-	-	0.170	-	0.080	-	0.200	-	-
東京レボレート	0.015	0.063	-	0.039	0.039	0.037	0.036	-	0.035	0.040	0.050

§ 7/10 オファーのオペと市場動向予想

週末となる明日の足許金利は0.075%近辺で取引されるだろう。共通担保オペはノーオペ予想。

7/10 の予定(国内)

8:50 6月の企業物価指数(日銀)
6月の消費動向調査(内閣府)

7/10 の予定(海外)

米 FRB議長の講演
ホストン連銀総裁の講演
7/12(日)EU首脳会議(リジャ支援を協議)

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	▲5,100	2,285,100	+2,285,100	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
2015/7/13 ~ 2015/10/13	8,000	1,050	1,050	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
2015/7/6 ~ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	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
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/6/30 ~ 2015/10/9	15,000	733	733	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	7/9 ~ 7/16	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応れなし
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	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	-	応れなし								
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																

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