

DAILY SIGNAL

平成27年7月15日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/15 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%の出合から始まった。
その後は0.075%近辺のビッドが厚くなり、0.075%超での取引が中心となった。
後場に入ってから0.07%前半の出合が散見されて引けた。本日まで実施された、
日銀金融政策決定会合では金融市場調節方針の現状維持が決定された。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	1,734,000	+1,734,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/15 のオペ結果
	7/15(水)		7/16(木)		7/17(金)		7/21(火)		
券	▲100		▲1,200		▲2,000		+1,000		9:20
財政	+3,400		▲800		+2,000		▲48,000		ノーオペ
過不足	+3,300		▲2,000		+0		▲47,000		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									11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(7/15-7/16)
国債買現先									▲0.400% 1億
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	▲600		▲400				▲1,300		ノーオペ
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入		+100							
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	+2,800		▲2,400		+1,300		▲48,300		
当座預金残高	2,275,400		2,273,000		2,274,300		2,226,000		
準備預金残高	2,062,700								
積み終了先	1,725,800								共通担保(本店) 0
超過準備	1,725,800								共通担保(全店) 66,048
非準備預金残高	212,700								国債買現先 0
準備預金進捗率	100.0%								CP買現先 0
平均	100.0%		予想込増減 ▲2,400		予想込増減 +1,300		予想込増減 ▲40,300		成長基盤強化 48,366
乖離率	0.0%		当預見込 2,273,000		当預見込 2,274,300		当預見込 2,234,000		被災地金融機関支援 3,241
									ロンハート残高 0

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,021,900

7/16 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 2,021,900

7/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 65,200

	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	0.055
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.075
出来値	-	-	-	-

7/14 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,222,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	7/10
長期国債	142	202	245
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	2.5	3.8	5.5
J-REIT	0.14	0.18	0.23
貸出支援基金	9.2	25	29
国庫短期証券	40	49	49
その他とも資産計	224	300	348
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	229
その他とも負債・純資産計	224	300	348

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
7/14	545(1Y)	-0.0109%	-0.0189%
7/9	544(3M)	-0.0059%	-0.0087%
7/8	543(6M)	-0.0156%	-0.0195%

7/14 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	199,056	133,462	65,594
	-5,202	-1,032	-4,170

*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	-	0.064	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.077	-	0.089	0.076	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.042	0.046	-	0.045	0.046	0.042	0.040	-	0.035	0.041	0.051

§ 7/16 オファターのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.075%近辺で取引されるだろう。

共通担保オペはロールオファーを予想する。

7/16 の予定(国内)

経済財政諮問会議

8:50 対外対内証券売買契約等の状況(財務省)

14:00 7月の金融経済月報(日銀)

7/16 の予定(海外)

米 FRB議長が半年次議会証言

新規失業保険申請件数

7月のNAHB住宅市場指数

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	▲2,400	2,273,000	+2,273,000	0.055	0.070	0.075	0.080	0.080	0.117	0.118	0.130	0.200							
					~	~	~	~	~	~	~	~	~							
					0.125	0.120	0.120	0.120	0.125	0.155	0.160	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	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
2015/7/13 ~ 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	4,003	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					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			
2015/6/30 ~ 2015/10/9	15,000	733	733	0.10%	固定金利	-	札割れ	7/16 ~ 7/23	担保範囲内	1	1	0.620%	固定金利	-	1.00	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																
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