

DAILY SIGNAL

平成27年7月16日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは172兆3000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.075%の出合から始まり、
その後も同水準で取引された。後場に入るとビットは薄くなり、
0.07%台前半の出合が散見されて引けた。
また、試取りの動きから0.12%超での出合も見られた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,723,000	+1,713,037

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/16 のオペ結果
	7/16(木)		7/17(金)		7/21(火)		7/22(水)		
券	▲1,400		▲1,000		+1,000		+1,000		9:20
財政	+100		+2,700		▲48,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲1,300		+1,700		▲47,000		+3,000		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									10:40
国庫短期証券買入									CP等買入(7/22-)
国債買現先									0.084%按分(84.7%) 3993億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(7/16-7/17)
CP買現先					▲1,300	+1,000			▲0.400% 6億
CP等買入	▲400		▲300	+1,300					12:50
社債等買入			▲100						ノーオペ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									共通担保(全店)×固定金利方式
被災地金融機関支援									(7/21-10/19)
貸出									0.10%(札割れ) 960億
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	▲1,700		+2,600		▲47,300		+7,000		
当座預金残高	2,273,700		2,276,300		2,229,000		2,236,000		
準備預金残高	2,056,700		2,056,700		2,056,700		2,056,700		
積み終了先	585,900		585,900		585,900		585,900		共通担保(本店) 0
超過準備	449,800		449,800		449,800		449,800		共通担保(全店) 66,048
非準備預金残高	217,000		217,000		217,000		217,000		国債買現先 0
準備預金進捗率	62.8%		62.8%		62.8%		62.8%		CP買現先 0
平均	3.2%		3.2%		3.2%		3.2%		成長基盤強化 48,366
乖離率	59.6%		59.6%		59.6%		59.6%		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) 2,021,900

7/17 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 752,300

7/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 25,100

	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	0.080
ビット	0.075	0.010	0.100	0.095
出来値	-	-	-	-

7/15 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,225,800

(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
7/16	546(3M)	-0.0020%	-0.0081%
7/14	545(1Y)	-0.0109%	-0.0189%
7/9	544(3M)	-0.0059%	-0.0087%

7/15 のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
195,820	-3,236	+899
134,361	-	-4,135
61,459	-	-

*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	0.068	-	0.069	0.117	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.130	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.077	-	0.097	0.120	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.034	0.073	-	0.044	0.045	0.041	0.039	-	0.035	0.041	0.051

§ 7/17 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台後半を中心に取引されるだろう。
共通担保オペは見送られると予想する。

7/17 の予定(国内)

8:50 7月の主要銀行貸出動向アンケート(日銀)
10:30 5月の毎月勤労統計確報(厚労省)

7/17 の予定(海外)

米 FRB副議長の講演
6月の消費者物価指数
6月の住宅着工件数

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	+2,600	2,276,300	+2,276,300	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
2015/7/21 ~ 2015/10/19	8,000	960	960	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
2015/7/13 ~ 2015/10/13	8,000	1,050	1,050	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
2015/7/6 ~ 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
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	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
2015/6/30 ~ 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	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/6/8 ~ 2015/9/7	8,000	700	700	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
2015/6/2 ~ 2015/9/11	15,000	5,550	5,550	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	-	応れなし

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