

DAILY SIGNAL

平成27年7月21日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

7/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは167兆6,000億円だった。
無担保コールON物は朝方0.07%台半ばで取引され、その後も同水準で推移した。
調達一巡後は0.07%近辺の出合いが散見され、引けとなった。
ターム物は1W物で0.11%台後半の出合い。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,676,000	+1,676,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/21 のオペ結果
	7/21(火)		7/22(水)		7/23(木)		7/24(金)		
券	+800		▲200		+0		▲1,000		9:20
財政	▲56,000		+4,000		▲1,000		▲8,000		ノーオペ
過不足	▲55,200		+3,800		▲1,000		▲9,000		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(7/23-)
国債買入				+11,900		+4,700			(残存1年以下)
国庫短期証券買入				+25,000					+0.005%按分(21.2%) 703億
国債買現先									(残存5年超10年以下)
共通担保(本店)	▲1,300	+1,000							+0.003%按分(21.5%) 4,009億
共通担保(全店)									10:40
CP買現先			▲200	+4,000					米ドル資金供給(7/23-7/30)
CP等買入	▲600								利率0.630% 1百万米ドル
社債等買入									11:50
ETF買入		+300		+300					国債補完供給(7/21-7/22)
J-REIT買入									▲0.400% 50億
被災地金融機関支援貸出							▲1,100	+1,100	12:50
国債補完供給		▲100	+100						ノーオペ
成長基盤強化支援貸出増加支援									13:00
									ノーオペ
									13:50
									国債補完供給(7/21-7/22)
									▲0.400% 1億
当座預金増減	▲55,900		+44,900		+3,700		▲9,000		
当座預金残高	2,221,100		2,266,000		2,269,700		2,260,700		
準備預金残高	2,012,700		2,012,700		2,012,700		2,012,700		
積み終了先	1,665,100		1,665,100		1,665,100		1,665,100		共通担保(本店) 0
超過準備	1,663,900		1,663,900		1,663,900		1,663,900		共通担保(全店) 65,743
非準備先残高	208,400		208,400		208,400		208,400		国債買現先 0
準備預金進捗率	97.3%		97.3%		97.3%		97.3%		CP買現先 0
平均	19.4%		19.4%		19.4%		19.4%		成長基盤強化 48,366
乖離率	78.0%		78.0%		78.0%		78.0%		被災地金融機関支援 3,241
			予想込増減	+44,900	予想込増減	+3,700	予想込増減	▲9,000	ロンハート残高 0
			当預見込	2,266,000	当預見込	2,269,700	当預見込	2,260,700	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,021,900

7/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 53,700

7/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,200

	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	0.060
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.075
出来値	-	-	-	-

7/17 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,229,700

(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%

7/17 のコール市場残高(前日比)		
合計	195,679	-1,285
有担	133,269	-769
無担	62,410	-516

*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	0.060	0.050	-	0.073	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.075	-	0.115	-	-	0.170	-	-	-	-
東京レボレート	0.057	0.062	-	0.045	0.045	0.041	0.040	-	0.035	0.041	0.051

7/22 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%を中心に取引されよう。
共通担保オペのオファーは見送られると予想する。

7/22 の予定(国内)

10:00 7月20日現在の営業毎旬報告(日銀)

7/22 の予定(海外)

米国 MBA住宅ローン申請指数
5月のFHFA住宅価格指数
6月の中古住宅販売件数

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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	+44,900	2,266,000	+2,266,000	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
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	8,008	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	7/23 ~ 7/30	担保範囲内	1	1	0.630%	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	7/16 ~ 7/23	担保範囲内	1	1	0.620%	固定金利	-	1.00

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