

DAILY SIGNAL

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

§ 7/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは172兆4,000億円。
無担保コールON物は朝方0.075%の出会いから始まり、その後も0.07%台後半で推移した。後場に入り、一部調整程度の出合いが0.07%台前半で見られ引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,724,000	+1,724,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/27 のオペ結果
	7/27(月)		7/28(火)		7/29(水)		7/30(木)		
券	+300		▲100		+0		+0		9:20 ノオペ 10:10 国債買入(7/29-) (残存5年超10年以下) ▲0.001%按分(28.0%) 4,004億 (物価連動債) ▲0.100円按分(20.0%) 201億 12:50 ノオペ 13:00 ノオペ
財政	▲16,800		▲4,800		▲1,000		+2,000		
過不足	▲16,500		▲4,900		▲1,000		+2,000		
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		+12,200				+4,200			
国庫短期証券買入				+20,000					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲2,600	+2,800							
CP買現先			▲300						
CP等買入	▲400								
社債等買入	▲100								
ETF買入									
J-REIT買入									
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	▲4,600		+14,800		+3,200		+2,000		
当座預金残高	2,256,900		2,271,700		2,274,900		2,276,900		
準備預金残高	2,050,800								
積み終了先	1,716,800								
超過準備	1,716,800								
非準備預金残高	206,100								
準備預金進捗率	99.3%								
平均	38.7%		予想込増減 +14,800		予想込増減 +3,200		予想込増減 +2,000		
乖離率	60.6%		当預見込 2,271,700		当預見込 2,274,900		当預見込 2,276,900		
共通担保(本店)			ノオペ		ノオペ		ノオペ		0
共通担保(全店)									65,944
国債買現先									0
CP買現先									0
成長基盤強化									48,366
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

7/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 14,800

7/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 800

	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	0.010	0.100	0.065
出来値	-	-	-	-

7/24 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,216,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	7/20
長期国債	142	202	245
CP等	2.2	2.2	1.9
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	5.6
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	51
その他とも資産計	224	300	350
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	228
その他とも負債・純資産計	224	300	350

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
7/23	547(3M)	-0.0020%	-0.0032%
7/16	546(3M)	-0.0020%	-0.0081%
7/14	545(1Y)	-0.0109%	-0.0189%

7/24 のコール市場残高(前日比)		
	合計	前日比
有担	211,609	+2,790
無担	138,065	+606
無担	73,544	+2,184

*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	0.030	0.050	-	-	0.160	-	0.170	-	-	-	-
最高	0.080	0.120	-	-	0.310	-	0.260	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.079	-	0.101	0.193	-	0.200	-	-	-	-
東京レボレート	0.046	0.077	-	0.045	0.045	0.041	0.040	-	0.036	0.041	0.051

§ 7/28 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は引き続き0.075%を中心に取引されるだろう。

共通担保オペはノオペを予想する。

7/28 の予定(国内)

未定 中曾日銀副総裁記者会見要旨

7/28 の予定(海外)

米 FOMC(7/29まで)

5月のS&Pケース・ラー住宅価格指数

7月の消費者信頼感指数

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想								
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
◎ ノオペ	+14,800	2,271,700	+2,271,700	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				
2015/7/27 ~ 2015/10/26	8,000	2,841	2,841	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				
2015/7/21 ~ 2015/10/19	8,000	960	960	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				
2015/7/13 ~ 2015/10/13	8,000	1,050	1,050	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				
2015/7/6 ~ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	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				
2015/7/3 ~ 2015/10/4	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	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	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				
2015/6/8 ~ 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				

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