

DAILY SIGNAL

平成27年7月30日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは172兆9,000億円。
無担保コールON物は朝方0.075%の出会いから始まり、その後はレート低下方向となつて0.07%前半まで推移した。後場に入り、0.07%近辺の出会いが散見され引けた。
本日実施された国庫短期証券(548回、3M)の入札結果は、最高利回りが▲0.004%となり、前回債(547回、3M、最高利回り▲0.002%)に比べて低下した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,729,000	+1,729,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/30 のオペ結果
	7/30(木)		7/31(金)		8/3(月)		8/4(火)		
券	▲800		▲600		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲600		+18,900		▲29,000		▲52,000		ノーオペ
過不足	▲1,400		+18,300		▲28,000		▲51,000		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									国債補完供給(7/30-7/31)
国債買現先									▲0.400% 22億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲1,400	+1,100			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲300		▲2,900	+4,000					共通担保(全店)(固定金利方式)
社債等買入			▲200	+300					(8/3-11/2)
ETF買入									0.10%(札割れ) 1,065億
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	▲1,700		+31,600		▲28,300		▲51,000		
当座預金残高	2,269,800		2,301,400		2,273,100		2,222,100		
準備預金残高	2,053,100								
積み終了先			ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,726,500								共通担保(全店) 65,944
非準備先残高	216,700								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.5%								CP買現先 0
平均	48.4%		予想込増減 +31,600		予想込増減 ▲28,300		予想込増減 ▲51,000		成長基盤強化 48,366
乖離率	51.2%		当預見込 2,301,400		当預見込 2,273,100		当預見込 2,222,100		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) 2,020,700

7/31 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 9,200

7/31 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 600

	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	0.045
ビッド	0.065	0.010	0.100	0.055
出来値	-	-	-	-

7/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,226,900

(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
7/30	548(3M)	-0.0040%	-0.0044%
7/23	547(3M)	-0.0020%	-0.0032%
7/16	546(3M)	-0.0020%	-0.0081%

7/29 のコール市場残高(前日比)

	合計	205,352	-5,566
有担	132,294	-3,407	
無担	73,058	-2,159	

*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	0.030	-	0.052	-	-	0.143	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.117	-	-	0.630	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.067	0.100	0.113	0.114	-	0.248	-	-	-	-
東京レボレート	0.035	▲0.011	-	0.042	0.041	0.040	0.039	-	0.035	0.040	0.050

§ 7/31 オファーのオペと市場動向予想

月末となる明日の足許金利は0.06%台で取引されるだろう。共通担保オペはノーオペを予想する。

7/31 の予定(国内)

8:30 6月の完全失業率(総務省)
6月の全国消費者物価指数(総務省)
14:00 住宅着工件数(国交省)

7/31 の予定(海外)

米 7月のシカゴ大学消費者信頼感確報
欧 6月の失業率
7月の消費者物価速報

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	
◎	ノーオペ	+31,600	2,301,400	+2,301,400	0.050	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
2015/8/3 ~ 2015/11/2	8,000	1,065	1,065	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
2015/7/27 ~ 2015/10/26	8,000	2,841	2,841	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
2015/7/21 ~ 2015/10/19	8,000	960	960	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	7/30 ~ 8/6	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし								
2015/7/6 ~ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	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								
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/6/30 ~ 2015/10/9	15,000	733	733	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	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