

DAILY SIGNAL

平成27年7月13日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは172兆1000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.074%の出合から始まり、その後は0.075~0.076%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが徐々に薄くなり、後場にかけては0.07%近辺の出合も散見された。また、試取の動きから、0.12%台での出合も見られた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,721,000	+1,721,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/13 のオペ結果
	7/13(月)		7/14(火)		7/15(水)		7/16(木)		
券	+1,200		+100		+0		▲1,000		9:20
財政	▲16,200		▲23,200		+2,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲15,000		▲23,100		+2,000		+0		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				+8,200					10:40
国庫短期証券買入				+17,500					社債買入(7/17-)
国債買現先									0.056%按分(2.5%) 1250億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)	▲1,000	+1,100							国債補完供給(7/13-7/14)
CP買現先			▲300						0億
CP等買入	▲300								12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入		+100		+100					13:00
J-REIT買入									ノーオペ
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	▲15,100		+2,400		+2,000		+0		
当座預金残高	2,270,100		2,272,500		2,274,500		2,274,500		
準備預金残高	2,056,600		2,056,600		2,056,600		2,056,600		
積み終了先	1,717,400		1,717,400		1,717,400		1,717,400		共通担保(本店) 0
超過準備	1,717,400		1,717,400		1,717,400		1,717,400		共通担保(全店) 66,048
非準備先残高	213,500		213,500		213,500		213,500		国債買現先 0
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		CP買現先 0
平均	93.3%		93.3%		93.3%		93.3%		成長基盤強化 48,366
乖離率	6.7%		6.7%		6.7%		6.7%		被災地金融機関支援 3,241
			予想込増減	+2,400	予想込増減	+2,000	予想込増減	+0	ロンハート残高 0
			当預見込	2,272,500	当預見込	2,274,500	当預見込	2,274,500	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,962,900

7/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0

7/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	6/30
長期国債	142	202	241
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	2.5	3.8	5.4
J-REIT	0.14	0.18	0.22
貸出支援基金	9.2	25	29
国庫短期証券	40	49	50
その他とも資産計	224	300	345
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	230
その他とも負債・純資産計	224	300	345

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
7/9	544(3M)	-0.0059%	-0.0087%
7/8	543(6M)	-0.0156%	-0.0195%
7/2	542(3M)	0.0000%	-0.0024%

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.060	0.060	0.040
ビッド	0.075	0.020	0.100	0.055
出来値	-	-	-	-

7/10 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,237,000

7/10 のコール市場残高(前日比)			
合計	198,249	-4,420	
有担	131,747	-1,232	
無担	66,502	-3,188	

*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	-	0.069	0.175	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	0.096	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.076	-	0.092	0.214	-	0.170	-	-	-	-
東京レボレート	0.028	0.038	-	0.040	0.040	0.038	0.038	-	0.035	0.040	0.050

§ 7/14 オフアのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07~0.076%で
取引されるだろう。共通担保オペはノーオペ予想。

7/14 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(1日目)
8:50 7月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

7/14 の予定(海外)

米 6月の輸入物価指数
6月の小売売上高
ヘルギー EU財務相会合

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	2,272,500	+2,272,500	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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	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				
2015/7/6 ~ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	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				
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	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				
2015/6/30 ~ 2015/10/9	15,000	733	733	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				
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/6/8 ~ 2015/9/7	8,000	700	700	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
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	-	応札なし				
2015/6/1 ~ 2015/8/31	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ	7/2 ~ 7/9	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし				

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