

DAILY SIGNAL

平成26年7月10日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは117兆5000億円。
無担ON物は朝方0.06%台前半の取引から始まり、その後も
同水準で推移した。後場に入り、一部0.06%近辺の出会いが
散見され引けた。本日実施されたTDB(465回債、3M物)の
入札結果は、最高利回り0.0317%、平均利回り0.0182%となった。

(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	-	-	1,175,000	1,175,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/10 のオペ結果
	7/10(木)		7/11(金)		7/14(月)		7/15(火)		
券	▲700		+0		+2,000		+1,000		9:20
財政	▲8,400		+600		▲34,000		▲4,000		ノーオペ
過不足	▲9,100		+600		▲32,000		▲3,000		9:30
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	社債等買入(7/16-)
国債買入				+5,200					0.111%按分(15.2%) 1001億
国庫短期証券買入									10:10
国債買現先									ノーオペ
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲5,800	+2,800			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲500		▲200						共通担保オペ(全店)(固定金利方式)
社債等買入									(7/14-10/14)
ETF買入		+100		+100					0.10%(札割) 2761億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲9,300		+5,700		▲35,000		▲3,000		
当座預金残高	1,529,200		1,534,900		1,499,900		1,496,900		
準備預金残高	1,388,200								共通担保(本店)
積み終了先	1,169,900								共通担保(全店)
超過準備	1,169,900								国債買現先
非準備先残高	141,000								CP買現先
準備預金進捗率	99.8%								成長基盤強化
平均	83.3%		予想込増減 +5,700		予想込増減 ▲35,000		予想込増減 ▲3,000		被災地金融機関支援
乖離率	16.4%		当預見込 1,534,900		当預見込 1,499,900		当預見込 1,496,900		ロンハート残高

今積み期間の所要準備額(積数) 1,852,500
7/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,300
7/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 900

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.125	0.060	0.090	0.085
ビッド	0.060	0.040	0.100	0.095
出来値	-	-	0.095	-

7/9 時点のマナタリーベース(単位:億円) 2,446,500

マナタリーベースの2014年末見通しは270兆円

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	6/30	14年末見通し
長期国債	142	167	190
CP等	2.2	2.0	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.0	3.5
J-REIT	0.14	0.15	0.17
貸出支援基金	9.2	17.9	18
国庫短期証券	40	45	-
その他とも資産計	224	258	290
銀行券	90	87	90
当座預金	107	152	175
その他とも負債・純資産計	224	258	290

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回り	平均利回り
7/10	465(3M)	0.0317%	0.0182%
7/8	464(6M)	0.0213%	0.0213%
7/3	463(3M)	0.0461%	0.0457%

7/9 のコール市場残高(前日比)			
合計	150,400	-246	
有担	94,777	-662	
無担	55,623	+416	

*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	0.065	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.135	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.064	0.078	-	-	0.340	-	0.150	-	-	0.300	-
東京レボ・レート	0.052	0.072	-	0.065	0.067	0.068	0.071	-	0.081	0.088	0.089

§ 7/11 オファーのオペと市場動向予想
足許金利は0.065%近辺で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

7/11 の予定(国内)
16:00 6月の投信概況(投信協会)

7/11 の予定(海外)
米 6月の財政収支
アトランタ連銀総裁の講演

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	+5,700	1,534,900	+1,534,900	0.030	0.070	0.070	0.080	0.117	0.118	0.118	0.125	0.200							
				~	~	~	~	~	~	~	~	~	~							
				0.125	0.130	0.135	0.140	0.145	0.150	0.150	0.150	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	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
2014/7/14 ~ 2014/10/14	8,000	2,761	2,761	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
2014/7/7 ~ 2014/10/6	8,000	2,670	2,670	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2014/6/30 ~ 2014/9/22	8,000	1,590	1,590	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2014/6/16 ~ 2014/9/8	8,000	1,430	1,430	0.10%	固定金利	-	札割れ	7/10 ~ 7/17	担保範囲内	0	0	0.590%	固定金利	-	札割れなし								
2014/6/9 ~ 2014/9/1	8,000	1,440	1,440	0.10%	固定金利	-	札割れ	7/3 ~ 7/10	担保範囲内	0	0	0.600%	固定金利	-	札割れなし								
2014/6/2 ~ 2014/8/25	8,000	3,430	3,430	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2014/5/28 ~ 2014/8/18	8,000	1,390	1,390	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2014/5/27 ~ 2014/9/5	15,000	5,420	5,420	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ありません。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