

DAILY SIGNAL

8/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは173兆2,000億円。
月初となる本日の無担保コールON物は朝方0.071%の出会いから始まり、
その後は0.073～0.074%を中心に推移した。一巡後も同水準で取引された。
後場にかけてビッドは徐々に薄くなり、引けた。

平成27年8月3日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,732,000	+1,732,000

(単位:億円)

	日銀速報 8/3(月)		日銀予想 8/4(火)		当社需給予想 8/5(水)8/6(木)				8/3 のオペ結果 9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(8/5-) (残存1年以下) +0.002%按分(83.9%) 700億 (残存10年超25年以下) +0.007%按分 (48.8%) 2408億 (残存25年超) +0.003%按分(95.0%) 1404億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
券	+1,200		+500		+1,000		+0		
財政	▲35,900		▲58,000		+4,000		▲24,000		
過不足	▲34,700		▲57,500		+5,000		▲24,000		
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				+12,000		+4,500			
国庫短期証券買入				+15,000					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲1,400	+1,100							
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲100						
社債等買入									
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	▲35,300		▲30,600		+9,500		▲24,000		
当座預金残高	2,265,400		2,234,800		2,244,300		2,220,300		
準備預金残高	2,060,100				共通担保オペ当社予想				
積み終了先	1,734,200		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		
超過準備	1,734,100								
非準備先残高	205,300								
準備預金進捗率	99.8%								
平均	61.3%		予想込増減 ▲30,600		予想込増減 +9,500		予想込増減 ▲24,000		
乖離率	38.5%		当預見込 2,234,800		当預見込 2,244,300		当預見込 2,220,300		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,021,100
8/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,900
8/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	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	0.065
ビッド	0.070	0.010	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

7/31 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,257,400

(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%

7/31 のコール市場残高(前日比)

合計	194,227	-11,323
有担	131,402	-316
無担	62,825	-11,007

*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	0.068	-	0.059	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.074	0.081	-	0.106	0.340	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.042	0.067	-	0.044	0.041	0.040	0.039	-	0.035	0.040	0.050

8/4 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07～0.075%を中心に
取引されるだろう。共通担保オペは見送られると予想する。

8/4 の予定(国内)

8:50 7月のマネタリーベース(日銀)
7月31日現在の営業毎旬報告(日銀)

8/4 の予定(海外)

米 6月の製造業受注指数
ユーロ圏 6月の生産者物価

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
◎ ノーオペ	▲30,600	2,234,800	+2,234,800	0.050	0.070	0.075	0.080	0.080	0.117	0.118
				～	～	～	～	～	～	～
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.125	0.155	0.160

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		
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		
2015/7/27 ～ 2015/10/26	8,000	2,841	2,841	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		
2015/7/21 ～ 2015/10/19	8,000	960	960	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		
2015/7/13 ～ 2015/10/13	8,000	1,050	1,050	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		
2015/7/6 ～ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	0.10%	固定金利	-	札割れ			米ドル資金供給オペ									
2015/7/3 ～ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	0.10%	固定金利	-	札割れ			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		
2015/6/30 ～ 2015/10/9	15,000	733	733	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		
2015/6/22 ～ 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		

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