

DAILY SIGNAL

平成27年8月4日(火)

上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 8/4 のオベと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは170兆4,000億円だった。
 本日の無担保コールON物は朝方0.075%の出しから始まり、
 その後は0.073~0.075%を中心に推移した。昨日対比でやや上昇し、
 一時0.076%も出合った。後場にかけて0.07~0.074%で出しが散発的に
 見られて引けた。

	即日オベ種類	オファー額	準備預金見込	所要対比
8:00	-	-	1,704,000	+1,704,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/4のオベ結果
	8/4(火)		8/5(水)		8/6(木)		8/7(金)		
券		+700		+600		+0		+0	9:20 ノーオベ
財政		▲58,400		+3,800		▲25,000		+2,000	10:40
過不足		▲57,700		+4,400		▲25,000		+2,000	米ドル資金供給(8/6-8/13) 利率0.640% 1百万米ドル
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	11:50 国債補完供給(8/4-8/5) ▲0.400% 5億
国債買入		+12,000		+4,700					12:50 ノーオベ
国庫短期証券買入		+15,000							13:00 ノーオベ
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲200						
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		▲30,800		+8,800		▲25,000		+2,000	
当座預金残高		2,234,600		2,243,400		2,218,400		2,220,400	
準備預金残高		2,030,800							
積み終了先		1,702,800	ノーオベ		ノーオベ		ノーオベ		共通担保(本店) 0
超過準備		1,702,800							共通担保(全店) 65,649
非準備先残高		203,800							国債買現先 0
準備預金進捗率		99.8%							CP買現先 0
平均		64.5%	予想増減	+8,800	予想増減	▲25,000	予想増減	+2,000	成長基盤強化 48,366
乖離率		35.3%	当預見込	2,243,400	当預見込	2,218,400	当預見込	2,220,400	被災地金融機関支援 3,241
									ロンバード残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,021,100
 8/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,300
 8/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	7/31
長期国債	142	202	249
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	5.7
J-REIT	0.14	0.18	0.24
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	354
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	354

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%

	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	0.080
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

8/3のコール市場残高(前日比)		
	合計	
有担	201,298	+7,071
無担	129,342	-2,060
	71,956	+9,131

8/3 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,220,900**

*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	-	0.064	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	0.140	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.082	-	0.097	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.052	0.076	-	0.047	0.044	0.041	0.039	-	0.035	0.040	0.050

§ 8/5 オファーのオベと市場動向予想

明日の足許金利は0.07~0.075%を中心に
 取引されるだろう。共通担保オベは期落ちなく、
 引き続きノーオベ予想。

8/5 の予定(国内)

なし

8/5 の予定(海外)

米 7月のADP雇用統計
 6月の貿易収支
 7月のISM非製造業指数

翌営業日の即日オベ予想				翌営業日の出合いレンジ予想								
即日オベ金額	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオベ	+8,800	2,243,400	+2,243,400	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	0.150	0.160	0.170	0.300

共通担保資金供給(全店)							共通担保資金供給(本店)							
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	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	-	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,000	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	-	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	-	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	-	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	-	米ドル資金供給オベ							
2015/7/3 ~ 2015/10/4	15,000	9,100	9,100	0.10%	固定金利	-	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	-	8/6 ~ 8/13	担保範囲内	1	1	0.640%	固定金利	-	1.00
2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	0.10%	固定金利	-	7/30 ~ 8/6	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(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会