

# DAILY SIGNAL

平成27年8月5日(水)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 8/5 のオベと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは171兆3,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は朝方0.075%の出会いから始まり、一部0.077%まで出合うなど、底堅い展開となった。  
その後は一部市場参加者による試し取りから0.12%台の出会いも散見され、加重平均金利は0.078%まで上昇した。

	即日オベ種類	オファー額	準備預金見込	所要対比
8:00	-	-	1,713,000	+1,713,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/5のオベ結果
	8/5(水)		8/6(木)		8/7(金)		8/10(月)		
券		+600		▲400		+0		+1,000	9:20 ノオベ 10:10 国債買入(8/7-) (残存1年超3年以下) +0.001%按分(17.3%) 3753億 (残存3年超5年以下) +0.006%按分(22.0%) 4258億 (残存5年超10年以下) +0.013%按分(19.6%) 4008億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政		+3,900		▲27,100		+2,000		▲30,000	
過不足		+4,500		▲27,500		+2,000		▲29,000	
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		+4,700				+12,000			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,600		
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲400						
社債等買入	▲100								
ETF買入				+200					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補充供給									
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減		+8,900		▲27,700		+14,000		▲30,600	
当座預金残高		2,243,500		2,215,800		2,229,800		2,199,200	
準備預金残高		2,039,900							
積み終了先		1,712,300	ノオベ		ノオベ		共通担保(本店)	8,000	
超過準備		1,712,300					共通担保(全店)	8,000	
非準備先残高		203,600							
準備預金進捗率		99.8%							
平均		67.7%	予想増減	▲27,700	予想増減	+14,000	予想増減	▲22,600	
乖離率		32.1%	当預見込	2,215,800	当預見込	2,229,800	当預見込	2,207,200	
								共通担保(本店) 0	
								共通担保(全店) 65,649	
								国債買現先 0	
								CP買現先 0	
								成長基盤強化 48,366	
								被災地金融機関支援 3,241	
								ロンバート残高 0	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,021,100  
8/6 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,700  
8/6 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	0.080
ビッド	0.076	0.010	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

8/4 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,189,400**

(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
8/5	549(6M)	-0.0158%	-0.0218%
7/30	548(3M)	-0.0040%	-0.0044%
7/23	547(3M)	-0.0020%	-0.0032%

8/4のコール市場残高(前日比)		
	合計	前日比
有担	205,925	+4,627
無担	128,772	-570
無担	77,153	+5,197

\*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	0.069	-	0.052	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.122	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.078	0.079	-	0.076	0.170	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.059	0.086	-	0.050	0.048	0.042	0.039	-	0.035	0.040	0.050

## § 8/6 オファーのオベと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台半ばを中心に取引されるだろう。共通担保オベは期落ち分をロールオファーするだろう。

## 8/6の予定(国内)

14:00 6月の景気動向指数速報(内閣府)  
未定 日銀金融政策決定会合(7日まで)

## 8/6の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数

翌営業日の即日オベ予想				翌営業日の出会いレンジ予想								
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
◎ ノオベ	▲27,700	2,215,800	+2,215,800	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	按分率	平均レート	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	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	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46												
2015/7/27 ~ 2015/10/26	8,000	2,841	2,841	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	-	2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	0.10%	固定金利	-	2015/6/30 ~ 2015/10/9	15,000	733	733	0.10%	固定金利	-	2015/6/22 ~ 2015/9/24	8,000	1,132	1,132	0.10%	固定金利	-
2015/7/21 ~ 2015/10/19	8,000	960	960	0.10%	固定金利	-	米ドル資金供給オベ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率	8/6 ~ 8/13	担保範囲内	1	1	0.640%	固定金利	-	7/30 ~ 8/6	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-														
2015/7/13 ~ 2015/10/13	8,000	1,050	1,050	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	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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会