

DAILY SIGNAL

平成27年8月6日(木)

上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 8/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは168兆9,000億円だった。
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、
その後は0.074～0.076%で推移し、昨日同様底堅い展開となった。
一巡後もビッドは残り、後場にかけて調整の出し合いが散見され引けた。
本日実施された国庫短期証券の入札結果(3M)は最高利回りが▲0.004%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
8:00	-	-	1,689,000	+1,689,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/6 のオペ結果
	8/6(木)		8/7(金)		8/10(月)		8/11(火)		
券	▲400		▲600		+1,000		+0		9:20
財政	▲26,400		+2,000		▲30,000		+3,000		ノーオペ
過不足	▲26,800		+1,400		▲29,000		+3,000		10:40
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	CP等買入(8/11-)
国債買入				+12,100					0.085%按分(14.5%) 3486億
国庫短期証券買入									11:50
国債買現先									国債補完供給(8/6-8/7)
共通担保(本店)					▲1,600	+2,400			▲0.400% 16億
共通担保(全店)									12:50
CP買現先									ノーオペ
CP等買入	▲400		▲300					+3,500	13:00
社債等買入									共通担保(全店)〈固定金利方式〉
ETF買入		+200							(8/10-11/9)
J-REIT買入									0.10%(札割れ) 2381億
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	▲27,000		+13,200		▲28,200		+6,500		
当座預金残高	2,216,500		2,229,700		2,201,500		2,208,000		
準備預金残高	2,016,400				共通担保オペ当社予想				
積み終了先	1,689,300		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店)
超過準備	1,689,300								共通担保(全店)
非準備先残高	200,100								国債買現先
準備預金進捗率	99.8%								CP買現先
平均	71.0%		予想込増減 +13,200		予想込増減 ▲28,200		予想込増減 +6,500		成長基盤強化
乖離率	28.9%		当預見込 2,229,700		当預見込 2,201,500		当預見込 2,208,000		被災地金融機関支援
									ロンハード残高

今 積み期間の所要準備額(積数)	2,021,100
8/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数)	3,100
8/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均)	300

	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	0.090
ビッド	0.076	0.020	0.100	0.095
出来値	-	-	-	-

8/5 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,197,700

(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
8/6	550(3M)	-0.0040%	-0.0052%
8/5	549(6M)	-0.0158%	-0.0218%
7/30	548(3M)	-0.0040%	-0.0044%

8/5 のコール市場残高(前日比)

合計	205,580	-345
有担	127,949	-823
無担	77,631	+478

*出所:營業每旬報告

*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	0.059	0.068	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	-	0.117	0.110	-	-	-	-	-	-
東京レポ・レート	0.060	0.086	-	0.050	0.047	0.043	0.040	-	0.035	0.040	0.050

§ 8/7 オファ-のオペと市場動向予想

3日積みとなる明日の足許金利は0.07%台半ばから後半で取引されるだろう。共通担保オペは期落ちがなく、ノーオペを予想する。

8/7 の予定(国内)

8:50 7月上中旬の貿易収支(財務省)
未定 日銀金融政策決定会合の結果
黒田日銀総裁会見

8/7 の予定(海外)

米 7月の雇用統計

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	当増増減	当増残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	+13,200	2,229,700	+2,229,700	0.050	0.075	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	オフー額	応礼額	落礼額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフー額	応礼額	落礼額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフー額	応礼額	落礼額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/8/10 ~ 2015/11/9	8,000	2,381	2,381	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
2015/8/3 ~ 2015/11/2	8,000	1,065	1,065	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/7/27 ~ 2015/10/26	8,000	2,841	2,841	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/7/21 ~ 2015/10/19	8,000	960	960	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフー額	応礼額	落礼額	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	8/6 ~ 8/13	担保範囲内	1	1	0.640%	固定金利	-	1.00								
2015/7/6 ~ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	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	-	応礼なし								
2015/7/3 ~ 2015/10/4	15,000	9,100	9,100	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/6/30 ~ 2015/10/9	15,000	733	733	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と、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 意登 第243号 加入協会 日本証券業協会