

DAILY SIGNAL

平成27年8月7日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは170兆5,000億円だった。
3日積みとなる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0.075%を中心に推移し、一部0.077%の出会いも見られた。
一巡後もビッドは残り、後場にかけて調整の出会いが見られて引けた。
本日実施された日銀金融政策決定会合では、金融政策の現状維持が決定された。

	即日オペ種類	オフア額	準備預金見込	所要対比
8:00	-	-	1,705,000	+1,705,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/7のオペ結果
	8/7(金)		8/10(月)		8/11(火)		8/12(水)		
券	▲500		+900		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	+1,900		▲31,300		+3,000		▲7,000		10:40 ノーオペ
過不足	+1,400		▲30,400		+3,000		▲7,000		
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	11:50 国債補完供給(8/7-8/10) ▲0.400% 2億
国債買入		+12,100							
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)			▲1,600	+2,400					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲300			+3,500			12:50 ノーオペ
社債等買入									13:00 ノーオペ
ETF買入				+100					
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	+13,200		▲29,800		+6,500		▲7,000		
当座預金残高	2,229,700		2,199,900		2,206,400		2,199,400		
準備預金残高	2,028,200		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店) 0
積み終了先	1,703,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 65,649
超過準備	1,702,600		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0
非準備先残高	201,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化 48,366
平均	80.6%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		被災地金融機関支援 3,241
乖離率	19.3%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,028,300
8/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 900
8/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オフア	0.120	0.060	0.060	0.090
ビッド	0.076	0.020	0.100	0.095
出来値	-	-	-	-

8/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,171,100**

(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%

8/6のコール市場残高(前日比)

	合計	204,103	-1,477
有担	129,168	+1,219	
無担	74,935	-2,696	

*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	0.120	-	0.120	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.083	-	0.113	0.118	0.118	-	-	-	-	-
東京レポ・レート	0.064	0.095	-	0.051	0.049	0.043	0.040	-	0.035	0.040	0.050

8/10 オフアのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.07%台半ばを中心に取引
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。

8/10の予定(国内)

8:50 6月の国際収支(財務省)
14:00 8月の金融経済月報(日銀)
15:00 7月の景気ウッチャー調査(内閣府)

8/10の予定(海外)

米 アトランタ連銀総裁の講演

即日オペ金額	翌営業日の即日オペ予想			翌営業日の出合いレンジ予想								
	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	▲29,800	2,199,900	+2,199,900	0.060	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	0.150	0.160	0.170	0.300

共通担保資金供給(全店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レート	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
2015/8/3 ~ 2015/11/2	8,000	1,065	1,065	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/7/27 ~ 2015/10/26	8,000	2,841	2,841	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/7/21 ~ 2015/10/19	8,000	960	960	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/7/13 ~ 2015/10/13	8,000	1,050	1,050	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/7/6 ~ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/7/3 ~ 2015/10/14	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

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
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
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
米ドル資金供給オペ							
期間	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
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