

DAILY SIGNAL

平成26年8月1日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは118兆5000億円だった。
本日の無担ON物は朝方0.067%の出会いからスタート。
その後も0.065~0.07%のレンジで取引される堅調な地合いと
なった。ビッドは終日底堅く、後場には入っても同水準での取引された。
ターム物は1W~1M物で0.11後半の出が見られた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,185,000	1,185,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/1 のオペ結果
	8/1(金)		8/4(月)		8/5(火)		8/6(水)		
券	▲500		+1,300		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲1,300		▲42,200		+4,000		+0		ノーオペ
過不足	▲1,800		▲40,900		+5,000		+1,000		10:10
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	国庫短期証券買入(8/5-)
国債買入	+6,400				+5,100				+0.000%按分(53.4%) 30004億
国庫短期証券買入					+30,000				国債買入(8/5-)
国債買現先									(残存1年以下)
共通担保(本店)									+0.016%按分(84.0%) 1100億
共通担保(全店)	▲10,400	+12,900	▲4,900	+2,900					(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.003%按分(46.7%) 4005億
CP等買入									12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									ノーオペ
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	+7,100		▲42,900		+40,100		+1,000		
当座預金残高	1,527,700		1,484,800		1,524,900		1,525,900		
準備預金残高	1,399,900								共通担保(本店)
積み終了先	1,183,600								共通担保(全店)
超過準備	1,181,900								国債買現先
非準備預金残高	127,800								CP買現先
準備預金進捗率	99.2%								成長基盤強化
平均	61.3%		予想込増減 ▲42,900		予想込増減 +40,100		予想込増減 +1,000		被災地金融機関支援
乖離率	37.9%		当預見込 1,484,800		当預見込 1,524,900		当預見込 1,525,900		ロンハート残高

今積み期間の所要準備額(積数) 1,905,400
8/4以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 15,700
8/4以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,300

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.060	0.085	0.060
ビッド	0.065	0.030	0.095	0.070
出来値	-	-	0.090	-

7/31時点のマナタリーベース(単位:億円) 2,431,900

マナタリーベースの2014年末見通しは270兆円

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	7/20	14年末見通し
長期国債	142	170	190
CP等	2.2	2.1	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.1	3.5
J-REIT	0.14	0.15	0.17
貸出支援基金	9.2	17.9	18
国庫短期証券	40	50	-
その他とも資産計	224	265	290
銀行券	90	86	90
当座預金	107	153	175
その他とも負債・純資産計	224	265	290

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
7/31	469(3M)	0.0337%	0.0289%
7/24	468(3M)	0.0300%	0.0264%
7/17	467(3M)	0.0263%	0.0206%

7/31のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
167,920	-11,190	-715
99,418	-	-10,475
68,502	-	-

*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	0.062	-	-	-	-	0.090	-	-	-	-
最高	0.135	0.120	-	-	-	-	0.145	-	-	-	-
加重平均	0.068	0.075	-	0.117	0.118	-	0.114	-	-	-	-
東京レボレート	0.073	0.086	-	0.064	0.064	0.065	0.065	-	0.077	0.085	0.085

8/4 オフアのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.06%台で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

8/4 の予定(国内)

8:50 7月のマナタリーベース(日銀)
10:00 7/30現在の営業毎旬報告(日銀)

8/4 の予定(海外)

欧 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	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	▲42,900	1,484,800	+1,484,800	0.030	0.070	0.070	0.080	0.085	0.118	0.118	0.125	0.200
					~	~	~	~	~	~	~	~	~
					0.125	0.130	0.135	0.140	0.145	0.150	0.150	0.170	0.300

共通担保資金供給(全店)					*当日物				
期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率		
2014/8/4 ~ 2014/11/4	8,000	2,850	2,850	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2014/8/1 ~ 2014/11/11	15,000	12,880	12,880	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2014/7/29 ~ 2014/11/7	10,000	10,060	10,060	0.10%	固定金利	-	1.00		
2014/7/28 ~ 2014/10/27	8,000	4,000	4,000	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2014/7/25 ~ 2014/11/5	15,000	10,140	10,140	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2014/7/23 ~ 2014/10/31	15,000	9,730	9,730	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2014/7/22 ~ 2014/10/20	8,000	3,991	3,991	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2014/7/18 ~ 2014/10/28	20,000	11,711	11,711	0.10%	固定金利	-	札割れ		

共通担保資金供給(本店)					*当日物				
期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	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	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46		
2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	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	按分率	平均レート	按分率	倍率		
7/31 ~ 8/7	担保範囲内	0	0	0.560%	固定金利	-	応札なし		
7/24 ~ 7/31	担保範囲内	0	0	0.570%	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