

DAILY SIGNAL

平成27年8月17日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは171兆9,000億円。
無担ON物は朝方0.075%の出会いから始まり、その後は0.075~0.076%のレンジで推移した。調達一巡後もビッドは残り、0.07%台前半での出会いとなった。また、試取りとみられる動きも散見され、0.125%での取引も見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,719,000	+1,719,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/17 のオペ結果
	8/17(月)		8/18(火)		8/19(水)		8/20(木)		
券	+900		+700		+0		▲1,000		9:20
財政	▲33,500		+4,600		+1,000		▲30,000		ノーオペ
過不足	▲32,600		+5,300		+1,000		▲31,000		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	ノーオペ
国債買入				+12,100					12:50
国庫短期証券買入				+15,000					ノーオペ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)									ノーオペ
共通担保(全店)	▲1,300	+1,200							
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲100						
社債等買入				+1,300					
ETF買入				+100					
J-REIT買入		+200							
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	▲32,600		+33,700		+1,000		▲31,000		
当座預金残高	2,264,400		2,298,100		2,299,100		2,268,100		
準備預金残高	2,062,600								
積み終了先	1,573,500								共通担保(本店) 0
超過準備	1,242,500								共通担保(全店) 66,339
非準備預金残高	201,800								国債買現先 0
準備預金進捗率	86.9%								CP買現先 0
平均	6.5%		予想込増減	+33,700	予想込増減	+1,000	予想込増減	▲31,000	成長基盤強化 48,366
乖離率	80.5%		当預見込	2,298,100	当預見込	2,299,100	当預見込	2,268,100	被災地金融機関支援 3,241
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,028,500
8/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 265,300
8/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 9,100

	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	0.075
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.085
出来値	-	-	-	-

8/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,253,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	8/10
長期国債	142	202	252
CP等	2.2	2.2	2.0
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	46
その他とも資産計	224	300	353
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	220
その他とも負債・純資産計	224	300	353

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
8/13	551(3M)	-0.0040%	-0.0056%
8/6	550(3M)	-0.0040%	-0.0052%
8/5	549(6M)	-0.0158%	-0.0218%

8/14 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	206,357	-1,628	+222
	130,686	-	-
	75,671	-	-1,850

*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	0.073	-	0.121	0.118	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.340	0.340	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.084	-	0.131	0.127	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.065	0.084	-	0.057	0.050	0.044	0.042	-	0.036	0.040	0.050

8/18 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台半ばで取引されよう。
共通担保オペは期落ちがなく、ノーオペを予想する。

8/18 の予定(国内)

13:00 7月の首都圏マンション販売

(不動産経済研究所)

8/18 の予定(海外)

米 7月の住宅着工件数

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	+33,700	2,298,100	+2,298,100	0.075	0.075	0.075	0.080	0.085	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	按分レート	平均レート	按分率	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
2015/8/17 ~ 2015/11/16	8,000	1,240	1,240	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
2015/8/10 ~ 2015/11/9	8,000	2,381	2,381	0.10%	固定金利	-	札割れ	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	4,003	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	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/7/21 ~ 2015/10/19	8,000	960	960	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/7/13 ~ 2015/10/13	8,000	1,050	1,050	0.10%	固定金利	-	札割れ	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
2015/7/6 ~ 2015/10/5	8,000	1,800	1,800	0.10%	固定金利	-	札割れ	8/13 ~ 8/20	担保範囲内	0	0	0.640%	固定金利	-	応札なし
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	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

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