

DAILY SIGNAL

平成27年8月18日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは174兆8,000億円。
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、同水準で取引されて引けた。また、試取りとみられる動きが複数件見られたことで、0.12%超の出会いも多く見られた。この影響で加重平均金利(速報)は0.083% (前日比+0.006%)となった。

(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	-	-	1,748,000	+1,748,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/18 のオペ結果
	8/18(火)		8/19(水)		8/20(木)		8/21(金)		
券	+700		+200		▲1,000		▲2,000		9:20
財政	+4,400		+3,100		▲30,000		+2,000		ノオベ
過不足	+5,100		+3,300		▲31,000		+0		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	ノオベ
国債買入		+12,100							10:40
国庫短期証券買入		+15,000							米ドル資金供給(8/20-8/27)
国債買現先									利率0.640% 2百万米ドル
共通担保(本店)									CP等買入(8/21-)
共通担保(全店)									0.085%按分(70.5%) 3,475億
CP買現先									12:50
CP等買入	▲100		▲200					+3,500	ノオベ
社債等買入		+1,300							13:00
ETF買入		+100							ノオベ
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	+33,500		+3,100		▲31,000		+3,500		
当座預金残高	2,297,900		2,301,000		2,270,000		2,273,500		
準備預金残高	2,093,500		2,093,500		2,093,500		2,093,500		
積み終了先	1,672,700		1,672,700		1,672,700		1,672,700		
超過準備	1,638,300		1,638,300		1,638,300		1,638,300		
非準備先残高	204,400		204,400		204,400		204,400		
準備預金進捗率	92.2%		92.2%		92.2%		92.2%		
平均	9.7%		9.7%		9.7%		9.7%		
乖離率	82.5%		82.5%		82.5%		82.5%		
共通担保(本店)									0
共通担保(全店)									66,339
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
ロンハート残高									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,028,500
8/19 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 158,400
8/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 5,700

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.060	0.060	0.085
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.095
出来値	-	-	-	-

8/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,220,200

(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
8/18	552(1Y)	-0.0247%	-0.0257%
8/13	551(3M)	-0.0040%	-0.0056%
8/6	550(3M)	-0.0040%	-0.0052%

8/17 のコール市場残高(前日比)

	合計	212,856	+6,499
有担	133,417	+2,731	
無担	79,439	+3,768	

*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	0.030	0.074	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.083	0.084	-	0.125	0.170	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.064	0.078	-	0.058	0.050	0.045	0.044	-	0.036	0.040	0.050

8/19 オフア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、ノオベを予想する。

8/19 の予定(国内)

8:50 7月の貿易統計(財務省)
13:30 6月の全産業活動指数(経産省)
14:00 6月の景気動向指数改定値(内閣府)

8/19 の予定(海外)

米 MBA住宅ローン申請指数
7月の消費者物価
7/28-29のFOMC議事録

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
◎ ノオベ	+3,100	2,301,000	+2,301,000	0.050	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										
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	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
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	オフア額	応札額	落札額	按分率	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	8/20 ~ 8/27	担保範囲内	2	2	0.640%	固定金利	-	1.00
2015/7/3 ~ 2015/10/14	15,000	9,100	9,100	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	-	応れなし

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