

DAILY SIGNAL

平成27年8月20日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは170兆7,000億円。
本日の無担保コールON物は朝方0.075%の出合から始まり、その後は
0.074~0.076%のレンジで取引された。調達一巡後もビッドは残り、
後場に入っても0.075%近辺での取引となった。
タームでは1W物で0.11%台後半の出合が見られた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,707,000	+1,707,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/20 のオペ結果
	8/20(木)		8/21(金)		8/24(月)		8/25(火)		
券	▲900		▲1,300		+0		+0		9:20
財政	▲28,500		+1,900		▲6,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲29,400		+600		▲6,000		+2,000		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				+8,300					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(8/20-8/21)
国債買現先									▲0.400% 60億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲2,800	+2,700			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲900		▲200	+3,500					共通担保(全店)(固定金利方式)
社債等買入									(8/24-11/24)
ETF買入		+200							0.10%(札割れ) 2691億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		▲100		+100					
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲30,200		+12,300		▲6,100		+2,000		
当座預金残高	2,271,000		2,283,300		2,277,200		2,279,200		
準備預金残高	2,061,400		1,693,500		1,693,500		1,693,500		
積み終了先	1,693,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,685,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 66,339
非準備先残高	209,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先 0
準備預金進捗率	96.3%		96.3%		96.3%		96.3%		CP買現先 0
平均	16.1%		16.1%		16.1%		16.1%		成長基盤強化 48,366
乖離率	80.2%		80.2%		80.2%		80.2%		被災地金融機関支援 3,241
当座預金増減	▲30,200		+12,300		▲6,100		+2,000		ローンハート残高 0
準備預金残高	2,061,400		1,693,500		1,693,500		1,693,500		
積み終了先	1,693,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		
超過準備	1,685,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		
非準備先残高	209,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		
準備預金進捗率	96.3%		96.3%		96.3%		96.3%		
平均	16.1%		16.1%		16.1%		16.1%		
乖離率	80.2%		80.2%		80.2%		80.2%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,028,500

8/21 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 74,100

8/21 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 2,900

	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	0.095
ビッド	0.074	0.010	0.100	0.102
出来値	-	-	-	-

8/19 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,256,300

(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
8/20	553(3M)	-0.0059%	-0.0087%
8/18	552(1Y)	-0.0247%	-0.0257%
8/13	551(3M)	-0.0040%	-0.0056%

8/19 のコール市場残高(前日比)

	合計	208,176	-5,492
有担	131,117	-676	
無担	77,059	-4,816	

*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	0.071	-	0.117	-	-	0.200	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.130	-	-	0.280	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.083	-	0.119	-	-	0.213	-	-	-	-
東京レボレート	0.066	0.094	-	0.063	0.052	0.046	0.045	-	0.036	0.041	0.050

8/21 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。

8/21 の予定(国内)

10:30 6月の毎月勤労統計確報(厚労省)
14:00 7月のスーパー売上高(日本チェーンストア協会)

8/21 の予定(海外)

米 8月の製造業PMI速報

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出合いレンジ予想																
即日オペ金額	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y								
◎	ノーオペ	+12,300	2,283,300	+2,283,300	0.055	0.075	0.075	0.080	0.085	0.117	0.118	0.130	0.200							
					~	~	~	~	~	~	~	~	~							
					0.125	0.120	0.120	0.120	0.140	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												
2015/8/24 ~ 2015/11/24	8,000	2,691	2,691	0.10%	固定金利	-	札割れ												
2015/8/17 ~ 2015/11/16	8,000	1,240	1,240	0.10%	固定金利	-	札割れ												
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												

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