

DAILY SIGNAL

平成27年8月21日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは173兆円。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%の出合から始まり、
その後は0.077~0.078%のレンジで取引される堅調な地合いとなった。
後場に入ってもビッドは残り、0.075%近辺での取引された。
タームでは1W物で0.11%台後半の出合。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,730,000	+1,730,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/21 のオペ結果
	8/21(金)		8/24(月)		8/25(火)		8/26(水)		
券	▲1,400		+0		+0		+0		9:20
財政	+1,900		▲9,600		+2,000		+0		ノーオペ
過不足	+500		▲9,600		+2,000		+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	国庫短期証券買入(8/25-)
国債買入		+8,300				+12,000			+0.009%按分(69.1%) 17,500億
国庫短期証券買入						+17,500			国債買入(8/25-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲2,800	+2,700					+0.003%按分(36.9%) 3,753億
共通担保(全店)									(残存3年超5年以下)
CP買現先									+0.004%按分(12.0%) 4,252億
CP等買入	▲200	+3,500	▲300						(残存5年超10年以下)
社債等買入				+100					▲0.001%按分(80.0%) 4,000億
ETF買入									11:50
J-REIT買入									国債補完供給(8/21-8/24)
被災地金融機関支援貸出									▲0.400% 150億
国債補完供給	+100	▲300	+300						12:50
成長基盤強化支援貸出増加支援									ノーオペ
									13:00
									ノーオペ
									13:50
									国債補完供給(8/21-8/24)
									▲0.400% 98億
当座預金増減	+11,900		▲9,600		+31,500		+0		
当座預金残高	2,282,900		2,273,300		2,304,800		2,304,800		
準備預金残高	2,076,900								
積み終了先	1,718,100								共通担保(本店) 0
超過準備	1,714,400								共通担保(全店) 66,339
非準備先残高	206,000								国債買現先 0
準備預金進捗率	98.6%								CP買現先 0
平均	25.8%		予想込増減 ▲9,600		予想込増減 +31,500		予想込増減 +0		成長基盤強化 48,366
乖離率	72.8%		当預見込 2,273,300		当預見込 2,304,800		当預見込 2,304,800		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

8/24 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 27,500

8/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,200

	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	0.090
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.100
出来値	-	-	-	-

8/20 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,226,900

(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%

8/20 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	206,310	-1,866	
	129,204	-1,913	
	77,106		+47

*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	-	0.071	-	-	0.165	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.123	-	-	0.200	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.082	-	0.110	-	-	0.178	-	-	-	-
東京レボレート	0.072	0.097	-	0.058	0.051	0.046	0.045	-	0.036	0.041	0.050

8/24 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。

8/24 の予定(国内)

被災地支援オペ通知日
10:00 8/20現在の営業毎旬報告(日銀)
14:00 6月の景気動向指数改定値(内閣府)

8/24 の予定(海外)

特になし

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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	▲9,600	2,273,300	+2,273,300	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				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
2015/8/24 ~ 2015/11/24	8,000	2,691	2,691	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
2015/8/17 ~ 2015/11/16	8,000	1,240	1,240	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
2015/8/10 ~ 2015/11/9	8,000	2,381	2,381	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2015/8/3 ~ 2015/11/2	8,000	1,065	1,065	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
2015/7/27 ~ 2015/10/26	8,000	2,841	2,841	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/7/21 ~ 2015/10/19	8,000	960	960	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
2015/7/13 ~ 2015/10/13	8,000	1,050	1,050	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
2015/7/6 ~ 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