

DAILY SIGNAL

平成27年8月26日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは175兆6,000億円。
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0.076~0.077%のレンジで取引された。調達一巡後は0.075%近辺での取引が散見されて引けた。
また、一部で試取りとみられる動きがあり、0.12%台での出合も見られた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,756,000	+1,756,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/26 のオペ結果
	8/26(水)		8/27(木)		8/28(金)		8/31(月)		
券	▲700		▲1,100		▲1,000		+1,000		9:20
財政	+1,800		▲2,500		+2,000		+3,000		ノーオペ
過不足	+1,100		▲3,600		+1,000		+4,000		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	国債買入(8/28-)
国債買入						+11,800			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.006%按分(66.8%) 3754億
国債買現先									国債買入(8/28-)
共通担保(本店)					▲11,300	+9,400	▲2,100		(残存3年超5年以下)
共通担保(全店)									+0.003%按分(44.6%) 4253億
CP買現先									国債買入(8/28-)
CP等買入	▲200		▲200					+3,500	(残存10年超25年以下)
社債等買入				+200					+0.000%按分(4.5%) 2408億
ETF買入		+300							国債買入(8/28-)
J-REIT買入									(残存期間25年超)
被災地金融機関支援					▲500	+400			▲0.003%按分(9.6%) 1405億
貸出									10:40
国債補完供給									CP等買入(8/31-)
成長基盤強化支援									0.084%按分(73.3%) 3484億
貸出増加支援									12:50
当座預金増減	+1,200		▲3,600		+10,800		+5,400		ノーオペ
当座預金残高	2,310,600		2,307,000		2,317,800		2,323,200		13:00
準備預金残高	2,102,400		2,102,400		2,102,400		2,102,400		共通担保(全店)(固定金利方式)
積み終り先	1,754,200		1,754,200		1,754,200		1,754,200		(8/28-12/8)
超過準備	1,752,300		1,752,300		1,752,300		1,752,300		0.10%(札割れ) 9350億
非準備先残高	208,200		208,200		208,200		208,200		共通担保(本店)
準備預金進捗率	99.4%		99.4%		99.4%		99.4%		共通担保(全店)
平均	35.5%		35.5%		35.5%		35.5%		8,000
乖離率	63.9%		63.9%		63.9%		63.9%		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

8/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 12,000

8/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	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	0.085
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.095
出来値	-	-	-	-

8/25 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,267,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	8/20
長期国債	142	202	254
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	5.9
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	48
その他とも資産計	224	300	357
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	227
その他とも負債・純資産計	224	300	357

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%

8/25 のコール市場残高(前日比)

	合計	209,332	-3,970
有担	129,222	-5,128	
無担	80,110	+1,158	

*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	-	0.070	0.114	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.122	0.118	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.080	0.090	-	0.091	0.117	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.063	0.085	-	0.060	0.054	0.047	0.045	-	0.036	0.041	0.049

8/27 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分がロールオファーされると予想。

8/27 の予定(国内)

8:50 対外対内証券売買契約等の状況(財務省)

8月上旬の貿易統計(財務省)

8/27 の予定(海外)

4~6月のGDP(2次速報)

週間の新規失業保険申請件数

7月の中古住宅販売仮契約

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	▲3,600	2,307,000	+2,307,000	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	按分率	平均レート	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率												
2015/8/28 ~ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	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	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	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/8/24 ~ 2015/11/24	8,000	2,691	2,691	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	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/8/17 ~ 2015/11/16	8,000	1,240	1,240	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70	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	4,008	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	2012/6/1 ~ 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	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	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	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	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	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	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	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70								
2015/7/13 ~ 2015/10/13	8,000	1,050	1,050	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	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70								

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