

DAILY SIGNAL

平成27年8月28日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは176兆円。
週末となる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。
後場に入ると0.074~0.075%での出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,760,000	+1,760,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/28 のオペ結果
	8/28(金)		8/31(月)		9/1(火)		9/2(水)		
券	▲1,300		+900		+1,000		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国庫短期証券買入(9/1-) +0.004%按分(93.9%) 8001億 国債買入(9/1-) (残存5年超10年以下) ▲0.003%按分(66.0%) 4007億 (変動利付債) ▲0.610円(全取) 1400億 11:50 国債補完供給(8/28-8/31) ▲0.400% 132億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)×固定金利方式 (9/1-12/11) 0.10%(札割れ) 8450億
財政	▲100		▲3,200		▲10,000		▲15,000		
過不足	▲1,400		▲2,300		▲9,000		▲14,000		
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		+12,100				+5,400			
国庫短期証券買入						+8,000			
国債買現先									
共通担保(本店)	▲11,300	+9,400	▲2,100	+1,600	▲7,300	+8,500			
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲2,900	+3,500					
社債等買入									
ETF買入		+300		+400					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出	▲500	+400							
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	+8,500		▲1,700		+5,600		▲14,000		
当座預金残高	2,315,900		2,314,200		2,319,800		2,305,800		
準備預金残高	2,101,700		1,757,900		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	1,757,900		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	1,757,400		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備先残高	214,200		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	99.7%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	48.4%		予想込増減 ▲1,700		予想込増減 +5,600		予想込増減 ▲14,000		
乖離率	51.3%		当預見込 2,314,200		当預見込 2,319,800		当預見込 2,305,800		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,028,500
8/31 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 6,600
8/31 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.100	0.060	0.055
ビッド	0.075	0.020	0.100	0.075
出来値	-	-	-	-

8/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,267,000**

(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
8/27	554(3M)	-0.0020%	-0.0056%
8/20	553(3M)	-0.0059%	-0.0087%
8/18	552(1Y)	-0.0247%	-0.0257%

8/27 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	208,905	129,468	79,437
	-1,105	+2,010	-3,115

*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	0.050	0.070	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.121	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.083	-	0.123	0.310	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.055	0.038	-	0.059	0.054	0.047	0.038	-	0.037	0.041	0.049

8/31 オファーのオペと市場動向予想

月初初となる足許金利は0.07%台前半で取引されよう。
共通担保オペは期落ちがなく、ノオベを予想する。

8/31 の予定(国内)

8:50 7月の鉱工業生産速報(経産省)
14:00 7月の住宅着工件数(国交省)

8/31 の予定(海外)

EU 8月の消費者物価速報

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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y										
◎ ノオベ	▲1,700	2,314,200	+2,314,200	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	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
2015/9/1 ~ 2015/12/11	15,000	8,450	8,450	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
2015/8/31 ~ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	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
2015/8/28 ~ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ					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	8/27 ~ 9/3	担保範囲内	2	2	0.640%	固定金利	-	1.00	8/20 ~ 8/27	担保範囲内	2	2	0.640%	固定金利	-	1.00
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																

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