

DAILY SIGNAL

平成27年9月1日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは177兆2,000億円。
無担保コールON物は朝方0.07%半ばの出会いから始まり、その後も同水準で推移した。
また、試し取りにより0.12%台の取引が一部で見られた。
後場に入ってから0.07%近辺が散発的に出会い、そのまま引けとなった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,772,000	+1,772,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/1 のオペ結果
	9/1(火)		9/2(水)		9/3(木)		9/4(金)		
券		+1,300		+600		+1,000		+0	9:20 ノーオペ
財政		▲6,700		▲15,500		▲5,000		+4,000	10:40 米ドル資金供給(9/3-9/11) 利率0.640% 0百万米ドル
過不足		▲5,300		▲14,900		▲4,000		+4,000	11:50 国債補完供給(9/1-9/2) ▲0.400% 20億
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	12:50 ノーオペ
国債買入		+5,400		+12,000					13:00 ノーオペ
国庫短期証券買入		+8,000							
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲7,300	+8,500						▲7,200	
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲100						
社債等買入			▲100						
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給								▲3,800	+6,800
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減		+9,200		▲3,100		▲4,000		▲200	
当座預金残高		2,323,400		2,320,300		2,316,300		2,316,100	
準備預金残高		2,112,900							
積み終了先		1,770,000							
超過準備		1,770,000							
非準備先残高		210,500							
準備預金進捗率		99.7%							
平均		54.8%	予想込増減	▲3,100	予想込増減	▲4,000	予想込増減	+14,800	
乖離率		44.9%	当預見込	2,320,300	当預見込	2,316,300	当預見込	2,331,100	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,022,700
9/2以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 5,200
9/2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	-	-	-	-

8/31 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,274,500

(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%

8/31のコール市場残高(前日比)			
	合計	201,839	-13,758
有担	138,529	+2,313	
無担	63,310	-16,071	

*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	0.053	0.073	-	0.125	0.118	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.140	0.170	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	-	0.130	0.122	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.048	0.060	-	0.058	0.053	0.046	0.034	-	0.036	0.041	0.049

9/2 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台で推移しよう。
T+2スタートの共通担保オペがオファーされると予想する。

9/2 の予定(国内)

8:50 8月のマネタリーベース(日銀)
10:00 8月31日現在の営業毎旬報告(日銀)

9/2 の予定(海外)

米 ベージュブック
8月のADP雇用統計
MBA住宅ローン申請指数

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	
◎	ノーオペ	▲3,100	2,320,300	+2,320,300	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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	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				
2015/8/31 ~ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	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				
2015/8/28 ~ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	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				
2015/8/24 ~ 2015/11/24	8,000	2,691	2,691	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				
2015/8/17 ~ 2015/11/16	8,000	1,240	1,240	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/8/10 ~ 2015/11/9	8,000	2,381	2,381	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2015/8/3 ~ 2015/11/2	8,000	1,065	1,065	0.10%	固定金利	-	札割れ	9/3 ~ 9/11	担保範囲内	0	0	0.640%	固定金利	-	応札なし				
2015/7/27 ~ 2015/10/26	8,000	2,841	2,841	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				

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