

DAILY SIGNAL

平成29年8月15日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは325兆3,000億円だった。
積み最終日となる本日の無担保コールON物は▲0.03%の割合から始まった。
その後は▲0.04～▲0.02%のレンジで取引が見られた。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.08%での出合も見られた。
同加重平均金利は、前日対比+0.002%の▲0.02%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	3,253,000	3,253,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/15 のオペ結果
	8/15(火)		8/16(水)		8/17(木)		8/18(金)		
券	+600		+0		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ
財政	+51,300		▲1,000		▲1,000		+2,000		10:10 ノーオペ
過不足	+51,900		▲1,000		▲1,000		+1,000		10:40 米ドル資金供給(8/17-8/24) 貸付利率1.660% 1百万米ドル
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	11:50 国債補完供給(8/15-8/16) ▲0.500% 全取 1,306億
国債買入		+7,400							12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入		+7,500							13:00 ノーオペ
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲100						
社債等買入									
ETF買入				+700					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+300	▲1,300	+1,300						
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+65,300		+900		▲1,000		+1,000		
当座預金残高	3,641,600		3,642,500		3,641,500		3,642,500		
準備預金残高	3,244,600		3,244,600		3,244,600		3,244,600		
積み終了先	3,244,600		3,244,600		3,244,600		3,244,600		共通担保(全店) 3,230
超過準備	3,244,600		3,244,600		3,244,600		3,244,600		国債買現先 0
非準備先残高	397,000		397,000		397,000		397,000		CP買現先 0
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		成長基盤強化 88,941
平均	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		被災地金融機関支援 5,205
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		ロンハート残高 0
当座預金増減	+65,300		+900		▲1,000		+1,000		
当座預金残高	3,641,600		3,642,500		3,641,500		3,642,500		
準備預金残高	3,244,600		3,244,600		3,244,600		3,244,600		
積み終了先	3,244,600		3,244,600		3,244,600		3,244,600		
超過準備	3,244,600		3,244,600		3,244,600		3,244,600		
非準備先残高	397,000		397,000		397,000		397,000		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
平均	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,997,900
8/16以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,997,900
8/16以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 96,700

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.035	-0.100
レボG.C	-	-0.105
ビッド	-0.070	0.000
レボG.C	-	-0.090
出来値	-	-

8/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,631,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	8/10
長期国債	282	361	401
CP等	2.2	2.3	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	14.9
J-REIT	0.27	0.36	0.41
貸出支援基金	31	41	47
国庫短期証券	43	50	33
その他とも資産計	383	476	509
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	357
その他とも負債・純資産計	383	476	509

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
8/9	701 (3M)	-0.1082%	-0.1110%
8/8	700 (6M)	-0.1131%	-0.1150%
8/3	699 (3M)	-0.1142%	-0.1178%

8/14 のコール市場残高(前日比)

	合計	平均利回
有担	82,830	-4.637
無担	19,455	-445
無担	63,375	-4,192

*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	-0.080	-	-	-0.040	-0.050	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-0.038	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.026	-	-	-0.030	-0.043	-	-	-	0.000	-	-
東京レボ・レート	-0.065	-0.095	-	-0.094	-0.095	-0.099	-0.102	-	-0.110	-0.122	-0.147

8/16 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.08～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想。

8/16 の予定(国内)

17:00 7月の業態別日銀当座預金残高(日銀)

8/16 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数

7月の住宅着工件数

FOMC議事録(7月25～26日分)

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	+900	3,642,500	+3,642,500	-0.080	-0.050	-0.050	-0.045	-0.045	-0.035	-0.030	-0.010	-0.010
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.080	0.100

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2017/8/14 ~ 2017/8/28	8,000	1,530	1,530	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/7 ~ 2017/8/21	8,000	1,310	1,310	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/31 ~ 2017/11/6	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/31 ~ 2017/8/14	8,000	1,480	1,480	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/24 ~ 2017/8/7	8,000	1,311	1,311	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/18 ~ 2017/7/31	8,000	1,591	1,591	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/10 ~ 2017/7/24	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/3 ~ 2017/7/18	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	-	札割れ

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2017/5/24 ~ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	札割れ
2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
米ドル資金供給オペ							
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
8/17 ~ 8/24	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
8/10 ~ 8/17	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	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