

DAILY SIGNAL

平成29年8月21日(月)
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319兆4,000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.045%の割合から始まり、その後は▲0.07~▲0.035%のレンジで取引された。調達一巡後はビットが薄くなり、後場に入って▲0.08%近辺での割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	-	-	3,194,000	3,194,000

(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(月)		8/22(火)		8/23(水)		8/24(木)		
券	+900		+600		+0		+0		9:20
財政	▲47,600		+900		▲2,000		▲14,000		ノーオペ
過不足	▲46,700		+1,500		▲2,000		▲14,000		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	ノーオペ
国債買入				+10,700					11:50
国庫短期証券買入				+7,500					国債補完供給(8/21-8/22)
国債買現先									▲0.600% 全取 226億
国債売現先									12:50
共通担保(本店)									ノーオペ
共通担保(全店)	▲1,300	+1,500							13:00
CP買現先									ノーオペ
CP等買入	▲100		▲100	+3,000					
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	+800	▲200	+200						
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	▲46,000		+23,500		▲2,000		▲14,000		
当座預金残高	3,603,900		3,627,400		3,625,400		3,611,400		
準備預金残高	3,188,400		3,182,100		ノーマル		ノーマル		共通担保(全店) 3,371
積み終了先	3,182,100		ノーマル		ノーマル		ノーマル		国債買現先 0
超過準備	3,181,900		ノーマル		ノーマル		ノーマル		CP買現先 0
非準備先残高	415,500		ノーマル		ノーマル		ノーマル		成長基盤強化 88,941
準備預金進捗率	99.3%		ノーマル		ノーマル		ノーマル		被災地金融機関支援 5,205
平均	19.4%		ノーマル		ノーマル		ノーマル		ロンハート残高 0
乖離率	80.0%		ノーマル		ノーマル		ノーマル		
予想込増減			+23,500		▲2,000		▲14,000		
当預見込			3,627,400		3,625,400		3,611,400		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,997.900
8/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 20,600
8/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 800

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.040	-	-0.100	-0.110
ビット	-0.070	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

8/18 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,705,300**

(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
8/17	703 (3M)	-0.1243%	-0.1275%
8/16	702 (1Y)	-0.1251%	-0.1281%
8/9	701 (3M)	-0.1082%	-0.1110%

8/18 のコール市場残高(前日比)

	合計	平均レート	倍率
有担	20,167	-	-675
無担	70,806	-	+4,442

*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	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	-	-	-0.029	-	0.000	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.096	-0.098	-	-0.099	-0.100	-0.101	-0.103	-	-0.110	-0.123	-0.148

§ 8/22 オファタ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。

8/22 の予定(国内)

10:00 8月20日現在の営業毎旬報告(日銀)

8/22 の予定(海外)

米 4~6月の住宅価格指数

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
◎ ノーマル	+23,500	3,627,400	+3,627,400	-0.080	-0.045	-0.045	-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
2017/8/21 ~ 2017/9/4	8,000	1,451	1,451	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

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

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