

DAILY SIGNAL

平成29年8月22日(火)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

8/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは321兆円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.045%の出来から始まり、その後は
▲0.075～▲0.035%のレンジで取引された。前日からさらに調達意欲が弱まる
展開となり、加重平均金利は前営業日対比▲0.002%の▲0.055%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	-	-	3,210,000	3,210,000

(単位:億円)

	日銀速報 8/22(火)		日銀予想 8/23(水)		当社需給予想				8/22 のオペ結果	
	8/22(火)		8/23(水)		8/24(木)		8/25(金)			
券	+500		▲300		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ	
財政	+300		▲800		▲14,000		▲1,000		10:10 ノーオペ	
過不足	+800		▲1,100		▲14,000		▲2,000		10:40 ノーオペ	
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	10:40 米ドル資金供給(8/24-8/31) 貸付利率 1.660% 1百万米ドル	
国債買入		+10,700							11:50 国債補完供給(8/22-8/23) ▲0.600% 全取 54億	
国庫短期証券買入		+7,500							12:50 ノーオペ	
国債買現先									13:00 ノーオペ	
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	▲100	+3,000	▲200							
社債等買入										
ETF買入		+700		+500						
J-REIT買入										
被災地金融機関支援 貸出										
国債補完供給	+200	▲100	+100				▲900	+900		
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	+22,700		▲700		▲14,000		▲2,000			
当座預金残高	3,626,600		3,625,900		3,611,900		3,609,900			
準備預金残高	3,211,600		3,208,500		3,207,100		3,207,100			
積み終了先	3,208,500		3,207,100		3,207,100		3,207,100			
超過準備	3,207,100		3,207,100		3,207,100		3,207,100			
非準備先残高	415,000		415,000		415,000		415,000			
準備預金進捗率	99.5%		99.5%		99.5%		99.5%			
平均	22.6%		22.6%		22.6%		22.6%			
乖離率	76.9%		76.9%		76.9%		76.9%			
共通担保オペ当社予想										
ノーオペ										
ノーオペ										
ノーオペ										
共通担保(全店) 3,371										
国債買現先 0										
CP買現先 0										
成長基盤強化 88,941										
被災地金融機関支援 5,205										
ロンバード残高 0										

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,997,900
8/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 16,100
8/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 700

	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
ビッド	-0.070	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

8/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,658,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	8/20
長期国債	282	361	402
CP等	2.2	2.3	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	15.1
J-REIT	0.27	0.36	0.42
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	510
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	365
その他とも負債・純資産計	383	476	510

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%

8/21 のコール市場残高(前日比)

合計	87,041	-3,932
有担	20,774	+607
無担	66,267	-4,539

*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	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.055	-	-	-0.036	-0.035	0.000	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.097	-0.101	-	-0.101	-0.101	-0.102	-0.105	-	-0.110	-0.123	-0.148

8/23 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。

8/23 の予定(国内)

8:50 6月末の国内銀行の資産・負債等(日銀)

8/23 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
7月の新築住宅販売件数
ダウ連銀総裁の講演

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
◎ ノーオペ	▲700	3,625,900	+3,625,900	-0.080	-0.045	-0.045	-0.045	-0.045	-0.035	-0.030	-0.010
				～	～	～	～	～	～	～	～
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	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
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
8/24 ～ 8/31	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
8/17 ～ 8/24	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