

DAILY SIGNAL

平成29年8月23日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 8/23 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▲0.075～▲0.035%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、後場に入って▲0.08%近辺での割合が散見されて引けた。
また、一部で試し取りの動きが見られ、0.001%での取引が散見された。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,214,000	3,214,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/23 のオペ結果
	8/23(水)		8/24(木)		8/25(金)		8/28(月)		
券	▲200		▲1,100		▲1,000		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲800		▲11,800		▲1,000		▲8,000		10:10 国債買入(8/25-)
過不足	▲1,000		▲12,900		▲2,000		▲8,000		(残存1年超3年以下)
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	(残存3年超5年以下)
国債買入						+9,100			+0.002% 按分(69.8%) 2,807億
国庫短期証券買入									(残存10年超25年以下)
国債買現先									+0.002% 按分(98.8%) 3,303億
国債売現先									(残存25年超)
共通担保(本店)									+0.007% 按分(79.4%) 2,009億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先									+0.002% 按分(19%) 1,004億
CP等買入	▲200		▲400				▲1,500		10:40 社債等買入(8/29-)
社債等買入									+0.042% 按分(55.6%) 1,001億
ETF買入		+500		+200					11:50 国債補完供給(8/23-8/24)
J-REIT買入									▲0.600% 全取 33億
被災地金融機関支援貸出					▲900	+900			12:50 ノーオペ
国債補完供給	+100								13:00 ノーオペ
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	▲600		▲13,100		+7,100		▲9,500		
当座預金残高	3,626,000		3,612,900		3,620,000		3,610,500		
準備預金残高	3,201,300		3,201,300		3,201,300		3,201,300		
積み終了先	3,198,400		3,198,400		3,198,400		3,198,400		共通担保(全店) +8,000
超過準備	3,198,400		3,198,400		3,198,400		3,198,400		共通担保(全店) 3,371
非準備先残高	424,700		424,700		424,700		424,700		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		CP買現先 0
平均	25.8%		25.8%		25.8%		25.8%		成長基盤強化 88,941
乖離率	73.8%		73.8%		73.8%		73.8%		被災地金融機関支援 5,205
			予想込増減 ▲13,100	予想込増減 ▲13,100	予想込増減 +7,100	予想込増減 +7,100	予想込増減 ▲1,500	予想込増減 ▲1,500	ロンハート残高 0
			当預見込 3,612,900	当預見込 3,612,900	当預見込 3,620,000	当預見込 3,620,000	当預見込 3,618,500	当預見込 3,618,500	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,997.900
8/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 13,200
8/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	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	-0.105
ビッド	-0.070	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

8/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,680,600**

(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%

8/22 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	91,635	21,022	70,613
	+4,594	+248	+4,346

*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	0.030	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.040	-	-	-0.028	-0.035	-	0.001	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.097	-0.097	-	-0.104	-0.101	-0.102	-0.105	-	-0.110	-0.123	-0.148

§ 8/24 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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

8/24 の予定(国内)

8:50 前週の対外及び対内証券売買契約等の状況 (財務省)

8/24 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数 (財務省)
7月の中古住宅販売件数

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
◎ ノーオペ	▲13,100	3,612,900	+3,612,900	-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

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