

DAILY SIGNAL

平成28年8月2日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは223兆2,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%で出合いが見られ、
その後は▲0.055%～▲0.03%のレンジで推移した。
また本日は一部で試し取りの動きが見られ、+0.01%での取引が散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,232,000	+2,232,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/2 のオペ結果
	8/2(火)		8/3(水)		8/4(木)		8/5(金)		
券	+700		+600		+0		+0		9:20
財政	▲13,200		▲46,700		▲24,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲12,500		▲46,100		▲24,000		+2,000		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				+9,000					10:40
国庫短期証券買入				+12,500					米ドル資金供給(8/4-8/12)
国債買現先									貸付利率0.890% 0百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(8/2-8/3)
CP買現先									▲0.500% 全取 251億
CP等買入	▲100		▲100						12:50
社債等買入	▲100		▲100						ノーオペ
ETF買入		+300							13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲300	+300						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲12,500		▲24,500		▲24,000		+2,000		
当座預金残高	2,996,200		2,971,700		2,947,700		2,949,700		
準備預金残高	2,700,000		2,241,600		2,241,200		296,200		
積み終了先	2,241,600		2,241,200		296,200				
超過準備	2,241,200		296,200						
非準備預金残高	296,200								
準備預金進捗率	99.8%								
平均	58.1%		予想込増減 ▲24,500		予想込増減 ▲24,000		予想込増減 +2,000		
乖離率	41.7%		当預見込 2,971,700		当預見込 2,947,700		当預見込 2,949,700		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,139,400
8/3以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 5,200
8/3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	-0.010	-	-0.100	-0.090
ビッド	-0.050	-0.025	0.000	-0.080
出来値	-	-	-	-

8/1 時点のマナターベース(単位:億円) 4,019,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	7/31
長期国債	202	282	332
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	8.7
J-REIT	0.18	0.27	0.32
貸出支援基金	25	31	33
国庫短期証券	49	43	55
その他とも資産計	300	383	443
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	303
その他とも負債・純資産計	300	383	443

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
7/28	623(3M)	-0.2745%	-0.2933%
7/21	622(3M)	-0.2505%	-0.2685%
7/15	621(1Y)	-0.3289%	-0.3587%

8/1のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	74,283	18,745	55,538
	+400	-954	+1,354

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.010	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.039	-0.020	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.086	-	-0.095	-0.098	-0.102	-0.105	-	-0.179	-0.229	-0.229

8/3 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は朝方▲0.055%～▲0.025%で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

8/3 の予定(国内)

8:50 8月の日銀当座預金増減要因見込み(日銀)
6月15～16日の金融政策決定会合議事要旨(日銀)
14:00 6月の基調的なインフレ率を補足するための指標(日銀)

8/3 の予定(海外)

米 7月のADP雇用統計
7月のISM非製造業指数
欧 7月のサービス業PMI確報

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	▲24,500	2,971,700	+2,971,700	-0.080	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.070	-0.070
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/8/1 ~ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/25 ~ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/19 ~ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/11 ~ 2016/7/25	8,000	2,690	2,690	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/8 ~ 2016/10/18	15,000	50	50	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/5 ~ 2016/10/14	15,000	60	60	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/4 ~ 2016/7/19	8,000	2,830	2,830	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/1 ~ 2016/10/11	15,000	70	70	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	按分率	平均レート	倍率
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%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
8/4 ~ 8/12	担保範囲内	0	0	0.890%	固定金利	- 応札なし
7/28 ~ 8/4	担保範囲内	130	130	0.870%	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ありません。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