

DAILY SIGNAL

平成28年8月5日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/5 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは222兆円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.025%の出会いからスタート。
その後は▲0.05%～▲0.01%のレンジで取引され、引けた。
本日オフアーされた共通担保オペは、期落ち額が80億円(オフアー額1兆5,000億円)であった
ところ、オフアー額が5,000億円に減額され、応札額は150億円となった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オフアー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,220,000	+2,220,000

	日銀速報 8/5(金)		日銀予想 8/8(月)		当社需給予想				8/5 のオペ結果
	8/5(金)		8/8(月)		8/9(火)				9:20 ノーオペ
券	+100		+800		+0				10:10
財政	+3,000		▲3,500		+2,000				国庫短期証券買入(8/9-)
過不足	+3,100		▲2,700		+2,000				▲0.002%按分(65.3%) 15,001億
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	国債買入(8/9-)
国債買入		+8,000				+12,500			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入						+15,000			▲0.008%按分(55.0%) 4,000億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)			▲4,800	+2,000	▲100	+200			▲0.021%按分(25.8%) 4,204億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.018%按分(13.7%) 4,304億
CP等買入	▲600		▲200			+3,500			11:50
社債等買入	▲100								国債補完供給(8/5-8/8)
ETF買入									▲0.500%全取 354億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+1,200	▲500	+500						共通担保(全店)〈固定金利〉
成長基盤強化支援									(8/9-11/28)
貸出増加支援									0% 全取 150億
当座預金増減	+11,100		▲5,200		+33,100				13:50
当座預金残高	2,961,400		2,956,200		2,989,300				国債補完供給(8/5-8/8)
準備預金残高	2,674,900		2,674,900		2,973,300				▲0.500%全取 136億
積み終了先	2,220,400		2,220,400		2,220,400				共通担保(本店)
超過準備	2,220,400		2,220,400		2,220,400				0
非準備先残高	286,500		286,500		286,500				共通担保(全店)
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%				10,250
平均	74.2%		74.2%		74.2%				国債買現先
乖離率	25.7%		25.7%		25.7%				0
									CP買現先
									0
									成長基盤強化
									68,139
									被災地金融機関支援
									4,581
									ロンバート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,152,100
8/8 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,900
8/8 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
オフアー	-0.010	-	-0.100	-0.090
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.075
出来値	-	-	-	-

8/4 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,959,400

(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
8/4	624(3M)	-0.1844%	-0.2100%
7/28	623(3M)	-0.2745%	-0.2933%
7/21	622(3M)	-0.2505%	-0.2685%

8/4 のコール市場残高(前日比)			
合計	75,956	-3,666	
有担	18,706	-218	
無担	57,250	-3,448	

*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	-0.070	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.010	-	-	0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.037	-0.010	-	-0.014	-	-	0.020	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.080	-0.072	-	-0.086	-0.090	-0.095	-0.100	-	-0.171	-0.229	-0.230

8/8 オフア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。

8/8 の予定(国内)

8:50 7月の金融政策決定会合における主な意見(日銀)
16年上期と6月の国際収支(財務省)
14:00 7月の景気ウオッチャー調査(内閣府)

8/8 の予定(海外)

米 FRBの7月の労働市場情勢指数

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想						
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
◎ ノーオペ	▲5,200	2,956,200	+2,956,200	-0.080	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.070
				～	～	～	～	～	～	～
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

共通担保資金供給(全店)					*当日物				共通担保資金供給(本店)					*当日物			
期間	オフアー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率		期間	オフアー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	
2016/8/9 ～ 2016/11/28	5,000	150	150	0.00%	固定金利	-	札割れ		2015/11/18 ～ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ	
2016/8/8 ～ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	固定金利	-	札割れ		2012/6/5 ～ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24	
2016/8/1 ～ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	0.00%	固定金利	-	札割れ		2012/6/1 ～ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70	
2016/7/25 ～ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	0.00%	固定金利	-	札割れ		2012/4/20 ～ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	
2016/7/19 ～ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	0.00%	固定金利	-	札割れ		米ドル資金供給オペ								
2016/7/11 ～ 2016/7/25	8,000	2,690	2,690	0.00%	固定金利	-	札割れ		期間	オフアー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	
2016/7/8 ～ 2016/10/18	15,000	50	50	0.00%	固定金利	-	札割れ		8/4 ～ 8/12	担保範囲内	0	0	0.890%	固定金利	-	札割れなし	
2016/7/5 ～ 2016/10/14	15,000	60	60	0.00%	固定金利	-	札割れ		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