

DAILY SIGNAL

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

8/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは221兆7,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%の落ちから始まり、その後は▲0.05%～▲0.03%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06%～▲0.055%近辺での出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	-	-	2,217,000	+2,217,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/8 のオペ結果
	8/8(月)		8/9(火)		8/10(水)		8/12(金)		
券	+800		▲200		+0		+0		9:20
財政	▲7,000		+200		▲16,000		▲8,000		ノーオペ
過不足	▲6,200		+0		▲16,000		▲8,000		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				+12,700					11:50
国庫短期証券買入				+15,000					国債補完供給(8/8-8/9)
国債買現先									▲0.500% 全取 254億
共通担保(本店)	▲4,800	+2,000	▲100	+200			▲100		12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲300	+3,500					ノーオペ
社債等買入									
ETF買入				+100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+500	▲300	+300						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲9,000		+31,400		▲16,000		▲8,100		
当座預金残高	2,952,400		2,983,800		2,967,800		2,959,700		
準備預金残高	2,665,500								
積み終了先	2,211,700								共通担保(本店) 0
超過準備	2,211,700								共通担保(全店) 7,500
非準備先残高	286,900								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	77.4%		予想込増減 +31,400		予想込増減 ▲16,000		予想込増減 ▲8,100		成長基盤強化 68,139
乖離率	22.5%		当預見込 2,983,800		当預見込 2,967,800		当預見込 2,959,700		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
8/9以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,500
8/9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	-
レボ	-	-0.100
レボ	-	-0.085
ビッド	-0.050	-
レボ	-	0.000
レボ	-	-0.070
出来値	-	-

8/5 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,970,500**

(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
8/8	625(6M)	-0.2021%	-0.2397%
8/4	624(3M)	-0.1844%	-0.2100%
7/28	623(3M)	-0.2745%	-0.2933%

8/5 のコール市場残高(前日比)			
合計	78,777	+2,821	
有担	18,822	+116	
無担	59,955	+2,705	

*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	0.001	-	-	-0.015	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.045	0.000	0.000	-0.016	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.080	-	-0.086	-0.088	-0.094	-0.100	-	-0.169	-0.229	-0.230

8/9 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.065%～▲0.02%で取引されよう。
共通担保オペは期落ちがあるが、低調な応札が続いていることからロールオファーは見送られると予想。

8/9 の予定(国内)

8:50 7月のマネースタック(日銀)

8/9 の予定(海外)

米 4~6月の非農業部門生産性速報

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	+31,400	2,983,800	+2,983,800	-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)					*当日物					共通担保資金供給(本店)					*当日物				
期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	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	オファー額	応札額	落札額	按分率	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	-	応札なし				
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