

DAILY SIGNAL

平成28年8月9日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは223兆1,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出合から始まった。その後は▲0.055%～▲0.03%のレンジで推移し、一巡後は▲0.065%近辺での出合が散見された。共通担保オペは、期落ちが50億円(オファー額1兆5,000億円)あったが、低調な応札が続いていたことから、ロールオファーは見送られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,231,000	+2,231,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/9 のオペ結果
	8/9(火)		8/10(水)		8/12(金)		8/15(月)		
券	▲300		▲900		+0		+1,000		9:20
財政	+600		▲16,300		▲8,000		+35,000		ノオベ
過不足	+300		▲17,200		▲8,000		+36,000		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	ノオベ
国債買入		+12,700							11:50
国庫短期証券買入		+15,000							国債補完供給(8/9-8/10)
国債買現先									▲0.500% 全取 361億
共通担保(本店)	▲100	+200			▲100		▲5,100		12:50
共通担保(全店)									ノオベ
CP買現先			▲400						13:00
CP等買入	▲300	+3,500							ノオベ
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	+300	▲400	+400						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+31,300		▲17,200		▲8,100		+30,900		
当座預金残高	2,983,700		2,966,500		2,958,400		2,989,300		
準備預金残高	2,683,800		2,231,100		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(本店) 0
積み終了先	2,231,100		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 7,570
超過準備	2,231,100		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		国債買現先 0
非準備先残高	299,900		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		成長基盤強化 68,139
平均	80.6%		予想込増減	▲17,200	予想込増減	▲8,100	予想込増減	+38,900	被災地金融機関支援 4,581
乖離率	19.3%		当預見込	2,966,500	当預見込	2,958,400	当預見込	2,997,300	ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,152,100
8/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,900
8/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	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	-0.095
ビッド	-0.030	-0.250	0.000	-0.080
出来値	-	-	-	-

8/8 時点のマナタリーベース(単位:億円) 3,960,800

(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%

8/8 のコール市場残高(前日比)		
合計	77,124	-1,653
有担	17,970	-852
無担	59,154	-801

*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	-0.035	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	-0.032	-	-0.009	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.081	-0.080	-	-0.085	-0.087	-0.094	-0.100	-	-0.166	-0.229	-0.230

8/10 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.07%～▲0.01%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。

8/10 の予定(国内)

8:50 6月の機械受注(内閣府)
7月の企業物価指数(日銀)

8/10 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
7月の財政収支

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	
◎ ノオベ	▲17,200	2,966,500	+2,966,500	-0.080	-0.060	-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