

DAILY SIGNAL

平成28年8月16日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは227兆2,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.03%の出合から始まり、
その後は▲0.035~▲0.055%のレンジで取引された。
後場においては、調整程度の出合が見られて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,272,000	+2,272,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/16 のオペ結果
	8/16(火)		8/17(水)		8/18(木)		8/19(金)		
券	+500		+100		▲1,000		▲1,000		9:20
財政	+3,000		+1,400		▲3,000		+1,000		ノオベ
過不足	+3,500		+1,500		▲4,000		+0		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		+5,400							10:40
国庫短期証券買入		+30,000							米ドル資金供給(8/18-8/25)
国債買現先									貸付利率0.900% 12百万米ドル
共通担保(本店)									CP等買入(8/19-)
共通担保(全店)									▲0.001% 按分(59.8%) 3,489億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲300		▲200					+3,500	国債補完供給(8/16-8/17)
社債等買入									▲0.500% 全取 268億
ETF買入									12:50
J-REIT買入									ノオベ
被災地金融機関支援									13:00
貸出									ノオベ
国債補完供給	+1,000	▲300	+300						13:50
成長基盤強化支援									国債補完供給(8/16-8/17)
貸出増加支援									▲0.500% 全取 6億
当座預金増減	+39,300		+1,600		▲4,000		+3,500		
当座預金残高	3,037,000		3,038,600		3,034,600		3,038,100		
準備預金残高	2,732,400								共通担保(本店)
積み終了先	1,187,000								共通担保(全店)
超過準備	636,200								国債買現先
非準備預金残高	304,600								CP買現先
準備預金進捗率	76.0%								成長基盤強化
平均	3.2%		予想込増減 +1,600		予想込増減 ▲4,000		予想込増減 +3,500		被災地金融機関支援
乖離率	72.8%		当預見込 3,038,600		当預見込 3,034,600		当預見込 3,038,100		ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,142,600
8/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 513,300
8/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 17,100

	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
レボG.C	-0.095	-0.085
ビッド	-0.030	0.000
出来値	-	-

8/15 時点のマナターベース(単位:億円) **4,006,600**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	8/10
長期国債	202	282	335
CP等	2.2	2.2	2.5
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	3.8	6.9	8.8
J-REIT	0.18	0.27	0.33
貸出支援基金	25	31	33
国庫短期証券	49	43	54
その他とも資産計	300	383	446
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	297
その他とも負債・純資産計	300	383	446

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
8/10	626(3M)	-0.1844%	-0.2224%
8/8	625(6M)	-0.2021%	-0.2397%
8/4	624(3M)	-0.1844%	-0.2100%

8/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	76,640	-5,323	-463
	18,496	-463	-
	58,144	-4,860	-

*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	-	-	-0.030	-0.025	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.044	-0.001	-	-0.022	-0.015	-	-0.020	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.087	-	-0.087	-0.088	-0.093	-0.097	-	-0.162	-0.230	-0.230

8/17 オファーのオペと市場動向予想

足許金利の中心レンジは▲0.055~▲0.035%となろう。
共通担保オペはノオベを予想する。

8/17 の予定(国内)

なし

8/17 の予定(海外)

米 週間MBA住宅ローン申請指数
7月26~27日のFOMC議事録
セントリス連銀総裁の講演

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	+1,600	3,038,600	+3,038,600	-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
2016/8/15 ~ 2016/8/29	8,000	1,941	1,941	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
2016/8/15 ~ 2016/11/28	5,000	150	150	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
2016/8/8 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	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
2016/8/1 ~ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	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
2016/7/25 ~ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/7/19 ~ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	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
2016/7/11 ~ 2016/7/25	8,000	2,690	2,690	0.00%	固定金利	-	札割れ	8/18 ~ 8/25	担保範囲内	12	12	0.900%	固定金利	-	1.00
2016/7/8 ~ 2016/10/18	15,000	50	50	0.00%	固定金利	-	札割れ	8/12 ~ 8/18	担保範囲内	0	0	0.900%	固定金利	-	応れなし

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