

DAILY SIGNAL

平成28年8月17日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは227兆5,000億円だった。
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。昨日と比べてビッドが薄い中、調達一巡後も地合に変化は見られず、後場にかけて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	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,275,000	+2,275,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/17 のオペ結果
	8/17(水)		8/18(木)		8/19(金)		8/22(月)		
券	+200		▲500		▲1,000		+0		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(8/19-) (残存5年超10年以下) 0.009%按分(60.2%) 4,302億 (残存10年超25年以下) 0.012%按分(47.2%) 2,011億 (残存25年超) ▲0.003%按分(60.6%) 1,201億 11:50 国債補完供給(8/17-8/18) ▲0.500% 全取 197億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+1,300		▲3,900		+1,000		▲47,000		
過不足	+1,500		▲4,400		+0		▲47,000		
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						+7,500			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲2,000		
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲200						
社債等買入							+3,500		
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+300	▲200	+200						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+1,400		▲4,400		+11,000		▲49,000		
当座預金残高	3,038,400		3,034,000		3,045,000		2,996,000		
準備預金残高	2,739,900		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店) 0		
積み終了先	2,155,000		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 4,361		
超過準備	1,954,600		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0		
非準備先残高	298,500		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0		
準備預金進捗率	90.9%		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化 68,139		
平均	6.5%		予想込増減 ▲4,400		予想込増減 +11,000		予想込増減 ▲41,000		
乖離率	84.4%		当預見込 3,034,000		当預見込 3,045,000		当預見込 3,004,000		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,142,600
8/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 195,700
8/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 6,700

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.015	-
レボ	-0.100	-0.095
ビッド	-0.030	-
出来値	0.000	-0.085

8/16 時点のマナタリーベース(単位:億円) 4,045,500

(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
8/17	627(1Y)	-0.2410%	-0.2480%
8/10	626(3M)	-0.1844%	-0.2224%
8/8	625(6M)	-0.2021%	-0.2397%

8/16 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	74,263	-2,377	
有担	19,307	+811	
無担	54,956	-3,188	

*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	-	-	-0.027	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.003	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.044	0.000	-	-0.021	-	-	0.200	-	-	-	-
東京レポレート	-0.085	-0.087	-	-0.087	-0.088	-0.093	-0.098	-	-0.148	-0.227	-0.228

8/18 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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

8/18 の予定(国内)

8:50 前週の対外及び対内証券売買契約等の状況 (財務省)

8/18 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数 (財務省)
サンフランシスコ連銀総裁の講演

7月の貿易統計(財務省)

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	▲4,400	3,034,000	+3,034,000	-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