

DAILY SIGNAL

平成28年8月23日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは226兆6,000億円だった。
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▲0.065～▲0.025%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	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,266,000	+2,266,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/23 のオペ結果
	8/23(火)		8/24(水)		8/25(木)		8/26(金)		
券	▲200		▲100		▲1,000		▲1,000		9:20
財政	+0		▲2,200		▲11,000		+0		ノーオペ
過不足	▲200		▲2,300		▲12,000		▲1,000		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							10:40
国庫短期証券買入		+25,100							米ドル資金供給(8/25-9/1)
国債買現先									貸付利率0.900% 11百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(8/23-8/24)
CP買現先									▲0.500% 全取 185億
CP等買入	▲200		▲500						12:50
社債等買入						+1,000			ノーオペ
ETF買入		+1,400							13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									
貸出							▲400	+900	
国債補完供給	+900	▲200	+200						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+39,500		▲2,600		▲11,000		▲500		
当座預金残高	3,031,900		3,029,300		3,018,300		3,017,800		
準備預金残高	2,728,800		2,263,000		2,263,000		2,263,000		
積み終了先	2,263,000		2,263,000		2,263,000		2,263,000		
超過準備	2,263,000		2,263,000		2,263,000		2,263,000		
非準備預金残高	303,100		303,100		303,100		303,100		
準備預金進捗率	99.2%		99.2%		99.2%		99.2%		
平均	25.8%		25.8%		25.8%		25.8%		
乖離率	73.4%		73.4%		73.4%		73.4%		
共通担保オベ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
									共通担保(全店) 4,212
									国債買現先 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) 2,142,600
8/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 16,400
8/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 700

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.015	-0.100
レボ	-0.095	-0.085
ビッド	-0.040	-0.300
出来値	0.000	-0.085

8/22 時点のマナターベース(単位:億円) 4,000,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	8/20
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	8.9
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	56
その他とも資産計	300	383	448
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	305
その他とも負債・純資産計	300	383	448

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
8/18	628(3M)	-0.2124%	-0.2341%
8/17	627(1Y)	-0.2410%	-0.2480%
8/10	626(3M)	-0.1844%	-0.2224%

8/22 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	71,394	-5,909	-
	19,831	+397	-
	51,563	-6,306	-

*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	-0.065	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.046	-0.001	-	-0.014	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.086	-0.089	-	-0.088	-0.090	-0.092	-0.096	-	-0.140	-0.224	-0.225

8/24 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▲0.06～▲0.03%となろう。
共通担保オベは見送られると予想する。

8/24 の予定(国内)

未定 8月の月例経済報告(内閣府)

8/24 の予定(海外)

米 週間MBA住宅ローン申請指数
住宅価格購入指数(4-6月)
中古住宅販売件数(7月)

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	▲2,600	3,029,300	+3,029,300	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/8/22 ~ 2016/9/5	8,000	1,891	1,891	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/15 ~ 2016/8/29	8,000	1,941	1,941	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/9 ~ 2016/11/28	5,000	150	150	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/8 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/1 ~ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/25 ~ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/19 ~ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/11 ~ 2016/7/25	8,000	2,690	2,690	0.00%	固定金利	- 札割れ

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	- 札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
8/25 ~ 9/1	担保範囲内	11	11	0.900%	固定金利	- 1.00
8/18 ~ 8/25	担保範囲内	12	12	0.900%	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