

DAILY SIGNAL

平成28年8月25日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/25 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは225兆5,000億円だった。
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▲0.06%～▲0.03%のレンジで取引された。調達一巡後も地合に変化は見られず、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,255,000	+2,255,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/25 のオペ結果
	8/25(木)		8/26(金)		8/29(月)		8/30(火)		
券	▲900		▲1,100		+0		▲1,000		9:20
財政	▲12,200		+500		▲11,000		+0		ノーオペ
過不足	▲13,100		▲600		▲11,000		▲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				+12,100					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(8/25-8/26)
国債買現先									▲0.500% 全取186億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲1,900	+1,900			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲300		▲300						共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入	▲100	+1,000							(8/29-9/12)
ETF買入				+200					0% 全取1,891億
J-REIT買入									13:50
被災地金融機関支援			▲400	+900					国債補完供給(8/25-8/26)
貸出									▲0.500% 全取61億
国債補完供給	+300	▲300	+300						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲12,500		+12,200		▲11,000		▲1,000		
当座預金残高	3,016,400		3,028,600		3,017,600		3,016,600		
準備預金残高	2,725,700		2,256,600		2,256,600		2,256,600		
積み終了先	2,256,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店)
超過準備	2,256,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
非準備預金残高	290,700		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先
準備預金進捗率	99.4%		99.4%		99.4%		99.4%		CP買現先
平均	32.3%		32.3%		32.3%		32.3%		成長基盤強化
乖離率	67.1%		67.1%		67.1%		67.1%		被災地金融機関支援
			予想込増減	+12,200	予想込増減	▲11,000	予想込増減	▲1,000	ローンハート残高
			当預見込	3,028,600	当預見込	3,017,600	当預見込	3,016,600	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,142,600
8/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 13,100
8/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	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	-0.095
ビッド	-0.040	-0.200	0.000	-0.080
出来値	-	-	-	-

8/24 時点のマナターベース(単位:億円) 4,037,500

(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	回号	最高利回	平均利回
8/25	629(3M)	-0.2104%	-0.2280%
8/18	628(3M)	-0.2124%	-0.2341%
8/17	627(1Y)	-0.2410%	-0.2480%

8/24 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	76,662	-2,866	-356
	19,481	-	-356
	57,181	-	-2,510

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.047	-0.002	-	-	-	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.088	-0.088	-	-0.088	-0.090	-0.093	-0.097	-	-0.139	-0.224	-0.230

8/26 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。
共通担保オペは見送られると予想する。

8/26 の予定(国内)

8:30 CPI(7月全国、8月都区部)

8/26 の予定(海外)

米 GDP(4-6月、改定値)
イェンFRB議長講演(シヤクソホール会議)
シヤクソ大消費者信頼感確報(8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	+12,200	3,028,600	+3,028,600	-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
2016/8/29 ~ 2016/9/12	8,000	1,891	1,891	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
2016/8/22 ~ 2016/9/5	8,000	1,891	1,891	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
2016/8/15 ~ 2016/8/29	8,000	1,941	1,941	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
2016/8/9 ~ 2016/11/28	5,000	150	150	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
2016/8/8 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/8/1 ~ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	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
2016/7/25 ~ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	0.00%	固定金利	-	札割れ	8/25 ~ 9/1	担保範囲内	11	11	0.900%	固定金利	-	1.00
2016/7/19 ~ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	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

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