

DAILY SIGNAL

平成28年8月30日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは227兆1,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、▲0.035%の出合から始まり、
その後は▲0.06%～▲0.02%のレンジで取引が見られた。
調達一巡後も地合いに変化は見られず引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,271,000	+2,271,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/30 のオペ結果
	8/30(火)		8/31(水)		9/1(木)		9/2(金)		
券	+300		+200		+1,000		+0		9:20
財政	+1,400		+900		▲5,000		▲15,000		ノオベ
過不足	+1,700		+1,100		▲4,000		▲15,000		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		+5,300		+11,700					10:40
国庫短期証券買入		+10,000							米ドル資金供給(9/1-9/9)
国債買現先									貸付利率0.880% 0百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(8/30-8/31)
CP買現先									▲0.500% 全取 127億
CP等買入	▲600		▲2,900	+3,500					国債補完供給(8/30-8/31)
社債等買入	▲200		▲100						▲0.500% 全取 233億
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	+400	▲400	+400						
成長基盤強化支援									▲1,200
貸出増加支援									
当座預金増減	+16,200		+13,700		▲4,000		▲16,200		
当座預金残高	3,023,300		3,037,000		3,033,000		3,016,800		
準備預金残高	2,736,000		2,727,900		2,727,900		2,727,900		
積み終了先	ノオベ		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店)
超過準備	2,272,900		2,272,900		2,272,900		2,272,900		共通担保(全店)
非準備先残高	287,300		287,300		287,300		287,300		国債買現先
準備預金進捗率	99.7%		99.7%		99.7%		99.7%		CP買現先
平均	48.4%		48.4%		48.4%		48.4%		成長基盤強化
乖離率	51.3%		51.3%		51.3%		51.3%		被災地金融機関支援
予想込増減	+13,700		+13,700		▲4,000		▲16,200		ロンハート残高
当預見込	3,037,000		3,037,000		3,033,000		3,016,800		0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,141,800
8/31 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,600
8/31 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

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

8/29 時点のマナターベース(単位:億円) 4,018,000

(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%

8/29 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
72,646	-3,117	19,011	-305
53,635	-2,812		

*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	-0.050	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.002	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.046	-0.029	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.091	-0.095	-	-0.089	-0.090	-0.094	-0.103	-	-0.137	-0.219	-0.220

8/31 オフアのオペと市場動向予想

足許は▲0.075～▲0.02%のレンジで取引されよう。
共通担保オペは見送られると予想する。

8/31 の予定(国内)

北野日銀審議委員が新潟県金融経済懇話会に出席・講演
8:50 7月の鉱工業生産速報(経産省)
14:00 7月の基調的なインフレ率を補足するための指標(日銀)

8/31 の予定(海外)

米 8月のADP雇用統計
週間のMBA住宅ローン申請指数
欧 8月CPI速報

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	+13,700	3,037,000	+3,037,000	-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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/8/29 ~ 2016/9/12	8,000	1,891	1,891	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
9/1 ~ 9/9	0	0	0	0.880%	固定金利	- 応札なし
8/25 ~ 9/1	0	11	11	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