

DAILY SIGNAL

平成29年8月16日(水)
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325兆円だった。
積み初日となる本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まった。その後は▲0.07~▲0.03%のレンジで取引が見られた。積み初日ということもあり、資金調達サイドのビット水準は昨日から後退し、同加重平均金利は▲0.047%と昨日から2.1bp低下した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,250,000	3,250,000

(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(水)		8/17(木)		8/18(金)		8/21(月)		
券	+100		▲300		▲1,000		+1,000		9:20 ノオペ 10:10 国債買入(8/18-) (残存5年超10年以下) ▲0.002% 按分(69.1%) 4.407億 (残存10年超25年以下) +0.010% 按分(99%) 2,003億 (残存25年超) +0.012% 按分(6.2%) 1,006億 11:50 国債補完供給(8/16-8/17) ▲0.500% 全取 1,318億 12:50 ノオペ 13:00 ノオペ
財政	+0		+1,100		+2,000		▲47,000		
過不足	+100		+800		+1,000		▲46,000		
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						+7,400			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,300		
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲200						
社債等買入									
ETF買入		+700		+800					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+1,300	▲1,300	+1,300						
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+700		+2,700		+8,400		▲47,300		
当座預金残高	3,642,300		3,645,000		3,653,400		3,606,100		
準備預金残高	3,236,000		3,236,000		3,236,000		3,236,000		
積み終了先	1,989,500		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) +8,000		
超過準備	802,000		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) +8,000		
非準備先残高	406,300		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) +8,000		
準備預金進捗率	81.2%		81.2%		81.2%		81.2%		
平均	3.2%		3.2%		3.2%		3.2%		
乖離率	78.0%		78.0%		78.0%		78.0%		
予想込増減	+2,700		+2,700		+8,400		▲39,300		
当預見込	3,645,000		3,645,000		3,653,400		3,614,100		
共通担保オペ当社予想									
共通担保(全店)							+8,000		
共通担保(本店)									
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							88,941		
被災地金融機関支援							5,205		
ロンハート残高							0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,997,900
8/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 563,900
8/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 18,800

	T/N	ユーロ円	T+2	CP現先	レボG.C
オファー	-0.040	-	-0.100	-0.105	-
ビット	-0.060	-	0.000	-0.085	-
出来値	-	-	-	-	-

8/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,696,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	8/10
長期国債	282	361	401
CP等	2.2	2.3	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	14.9
J-REIT	0.27	0.36	0.41
貸出支援基金	31	41	47
国庫短期証券	43	50	33
その他とも資産計	383	476	509
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	357
その他とも負債・純資産計	383	476	509

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
8/16	702 (1Y)	-0.1251%	-0.1281%
8/9	701 (3M)	-0.1082%	-0.1110%
8/8	700 (6M)	-0.1131%	-0.1150%

8/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	81,748	-1.082
有担	19,629	+174	
無担	62,119	-1,256	

*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	-0.075	-	-	-0.040	-0.050	-0.025	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	0.010	0.000	-	-	-	-	-
加重平均	-0.047	-	-	-0.038	-0.030	-0.023	0.040	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.094	-0.096	-	-0.096	-0.098	-0.100	-0.102	-	-0.110	-0.122	-0.148

8/17 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.08~+0.001%のレンジで取引されよう。
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。

8/17 の予定(国内)

8:50 7月の貿易統計(財務省)

8/17 の予定(海外)

米 7月鉱工業生産
タラス連銀総裁講演
欧 ECB理事会議事要旨

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
◎ ノオペ	+2,700	3,645,000	+3,645,000	-0.080	-0.050	-0.050	-0.045	-0.045	-0.035	-0.030	-0.010	-0.010
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.080	0.100

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2017/8/14 ~ 2017/8/28	8,000	1,530	1,530	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/7 ~ 2017/8/21	8,000	1,310	1,310	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/31 ~ 2017/11/6	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/31 ~ 2017/8/14	8,000	1,480	1,480	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/24 ~ 2017/8/7	8,000	1,311	1,311	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/18 ~ 2017/7/31	8,000	1,591	1,591	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/10 ~ 2017/7/24	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/3 ~ 2017/7/18	8,000	1,590	1,590	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	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2017/5/24 ~ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	札割れ
2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ
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%	1.24
米ドル資金供給オペ							
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
8/17 ~ 8/24	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
8/10 ~ 8/17	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	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