

DAILY SIGNAL

平成28年8月10日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは222兆3,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%の合出から始まった。その後は▲0.055%～▲0.02%のレンジで取引され、一部▲0.015%での合出も見られた。
調達一巡後はヒットが薄くなり、▲0.06%近辺での合出が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,223,000	+2,223,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/10 のオペ結果
	8/10(水)		8/12(金)		8/15(月)		8/16(火)		
券	▲800		▲700		+1,000		+0		9:20
財政	▲16,000		▲7,300		+35,000		▲2,000		ノーオペ
過不足	▲16,800		▲8,000		+36,000		▲2,000		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	国債買入(8/15-)
国債買入									(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入						+11,400			▲0.008%按分(62.4%) 4,008億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)			▲100		▲5,100	+1,900			▲0.004%按分(70.7%) 4,209億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先									▲0.019%按分(40.9%) 2,002億
CP等買入	▲400		▲1,200						(残存25年超)
社債等買入				+1,100					+0.000%按分(85.9%) 1,204億
ETF買入									10:40
J-REIT買入									米ドル資金供給(8/12-8/18)
被災地金融機関支援									貸付利率0.900% 0百万米ドル
貸出									11:50
国債補完供給	+400	▲200	+200						国債補完供給(8/10-8/12)
成長基盤強化支援									▲0.500% 全取 210億
貸出増加支援									12:50
当座預金増減	▲17,000		▲8,000		+44,200		▲2,000		ノーオペ
当座預金残高	2,966,700		2,958,700		3,002,900		3,000,900		13:00
準備預金残高	2,675,300		2,221,400		ノオオペ		ノオオペ		共通担保(本店)
積み終了先	2,221,400		ノオオペ		ノオオペ		ノオオペ		共通担保(全店)
超過準備	2,221,300		ノオオペ		ノオオペ		ノオオペ		国債買現先
非準備先残高	291,400		ノオオペ		ノオオペ		ノオオペ		CP買現先
準備預金進捗率	99.9%		ノオオペ		ノオオペ		ノオオペ		成長基盤強化
平均	87.1%		ノオオペ		ノオオペ		ノオオペ		被災地金融機関支援
乖離率	12.8%		ノオオペ		ノオオペ		ノオオペ		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,152,100
8/12 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 1,000
8/12 以降の残り積み立て額(残り所要)平均) 200

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.010	-0.100
レボ	-0.030	0.000
ビッド	-0.030	-0.070
出来値	-	-

8/9 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,992,300**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	7/31
長期国債	202	282	332
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	8.7
J-REIT	0.18	0.27	0.32
貸出支援基金	25	31	33
国庫短期証券	49	43	55
その他とも資産計	300	383	443
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	303
その他とも負債・純資産計	300	383	443

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
8/10	626(3M)	-0.1844%	-0.2224%
8/8	625(6M)	-0.2021%	-0.2397%
8/4	624(3M)	-0.1844%	-0.2100%

8/9 のコール市場残高(前日比)		
合計	80,781	+3,657
有担	18,540	+570
無担	62,241	+3,087

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.047	0.000	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.083	-0.086	-	-0.085	-0.088	-0.094	-0.100	-	-0.163	-0.229	-0.230

8/12 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.07%～▲0.01%で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

8/12 の予定(国内)

8:50 前週の対外対内証券売買契約等の状況 (財務省)

8/12 の予定(海外)

米 7月の小売売上高 (財務省)
7月の生産者物価
欧 4～6月のGDP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
◎	ノオオペ	▲8,000	2,958,700	+2,958,700	-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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	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	オフア額	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	8/12 ~ 8/18	担保範囲内	0	0	0.900%	固定金利	-	札割れなし
2016/7/8 ~ 2016/10/18	15,000	50	50	0.00%	固定金利	-	札割れ	8/4 ~ 8/12	担保範囲内	0	0	0.890%	固定金利	-	札割れなし

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