

DAILY SIGNAL

平成28年8月12日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは221兆2,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.035%の出合から始まり、その後は▲0.045～▲0.02%のレンジで取引される堅調な地合となった。一部▲0.01%まで取り上がる動きも見られた。調達一巡後はビッドがやや薄くなり、▲0.06%近辺で調整程度の出合が散見されて引けた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,212,000	+2,212,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/12 のオペ結果
	8/12(金)		8/15(月)		8/16(火)		8/17(水)		
券	▲600		+800		+0		+0		9:20
財政	▲7,400		+30,100		▲2,000		▲1,000		ノーオペ
過不足	▲8,000		+30,900		▲2,000		▲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	国庫短期証券買入(8/16-)
国債買入				+11,800		+5,300			+0.000%按分(47.5%) 30,007億
国庫短期証券買入						+30,000			国債買入(8/16-)
国債買現先									(残存5年超10年以下)
共通担保(本店)			▲5,100	+1,900					▲0.008%按分(11.2%) 4,305億
共通担保(全店)	▲100								(変動利付債)
CP買現先			▲800						+0.000円(93.8%) 1,006億
CP等買入	▲1,200		▲100						
社債等買入									11:50
ETF買入		+1,100		+200					国債補完供給(8/12-8/15)
J-REIT買入									▲0.500% 全取 231億
被災地金融機関支援									12:50
貸出									ノーオペ
国債補完供給	+200	▲200	+200						13:00
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									
当座預金増減	▲8,200		+39,000		+33,300		▲1,000		
当座預金残高	2,958,500		2,997,500		3,030,800		3,029,800		
準備預金残高	2,667,100								共通担保(本店)
積み終了先	2,212,100								共通担保(全店)
超過準備	2,211,800								国債買現先
非準備先残高	291,400								CP買現先
準備預金進捗率	100.0%								成長基盤強化
平均	96.8%		予想込増減	+39,000	予想込増減	+33,300	予想込増減	▲1,000	被災地金融機関支援
乖離率	3.2%		当預見込	2,997,500	当預見込	3,030,800	当預見込	3,029,800	ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,152,100

8/15 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 0

8/15 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 0

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.010	-
レボ	-	-0.100
レボ	-	-0.095
レボ	-0.030	-
レボ	-	0.000
レボ	-	-0.085
出来値	-	-

8/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,976,100

(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%

8/10 のコール市場残高(前日比)		
合計	79,453	-1,328
有担	18,751	+211
無担	60,702	-1,539

*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	-0.060	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.041	0.000	-	-0.023	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.079	-0.075	-	-0.086	-0.088	-0.093	-0.099	-	-0.163	-0.230	-0.230

8/15 オファーのオペと市場動向予想

積み最終日の足許金利は▲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。

8/15 の予定(国内)

8:50 4～6月のGDP1次速報(内閣府)
10:00 8月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

8/15 の予定(海外)

米 8月のNY連銀製造業景況感指数

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	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	+39,000	2,997,500	+2,997,500	-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
2016/8/15 ~ 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	オファー額	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	-	応札なし
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	-	応札なし

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