

# DAILY SIGNAL

平成28年8月3日(水)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## 8/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは221兆8,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%で出合いが見られた。  
その後は▲0.065%～▲0.03%のレンジで推移した。  
後場ではほとんど出合わず引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,218,000	+2,218,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/3 のオペ結果
	8/3(水)		8/4(木)		8/5(金)		8/8(月)		
券	+600		+0		+0		+1,000		9:20
財政	▲46,700		▲19,100		+2,000		▲5,000		ノーオペ
過不足	▲46,100		▲19,100		+2,000		▲4,000		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(8/5-)
国債買入		+9,000				+7,800			(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入		+12,500							▲0.033%按分(100.0%) 4,302億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									+0.002%按分(96.8%) 2,002億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先									+0.005%按分(86.0%) 1,204億
CP等買入	▲100		▲100						(物価連動債)
社債等買入	▲100			+100					▲0.360円(65.0%) 250億
ETF買入									11:50
J-REIT買入									国債補完供給(8/3-8/4)
被災地金融機関支援									▲0.500% 全取 444億
貸出									12:50
国債補完供給	+300	▲500	+500						ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノーオペ
当座預金増減	▲25,000		▲18,600		+9,800		▲8,800		
当座預金残高	2,971,200		2,952,600		2,962,400		2,953,600		
準備預金残高	2,671,900		2,671,900		2,671,900		2,671,900		
積み終了先	2,214,500		2,214,500		2,214,500		2,214,500		共通担保(本店)
超過準備	2,214,500		2,214,500		2,214,500		2,214,500		共通担保(全店)
非準備先残高	299,300		299,300		299,300		299,300		国債買現先
準備預金進捗率	99.8%		99.8%		99.8%		99.8%		CP買現先
平均	61.3%		61.3%		61.3%		61.3%		成長基盤強化
乖離率	38.5%		38.5%		38.5%		38.5%		被災地金融機関支援
			予想込増減	▲18,600	予想込増減	+9,800	予想込増減	▲800	ロンバート残高
			当預見込	2,952,600	当預見込	2,962,400	当預見込	2,961,600	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,139,400  
8/4以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,800  
8/4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		
オファー	-0.010	-0.010
レボG.C	-0.100	-0.085
ビッド	-0.050	-0.025
0.000	-0.075	
出来値	-	-

8/2 時点のマナターベース(単位:億円) 4,006,100

(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
7/28	623(3M)	-0.2745%	-0.2933%
7/21	622(3M)	-0.2505%	-0.2685%
7/15	621(1Y)	-0.3289%	-0.3587%

## 8/2のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	79,100	+4,817	
	19,571	+826	
	59,529	+3,991	

\*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	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.041	-0.010	-	-0.013	-0.020	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.086	-	-0.094	-0.097	-0.101	-0.105	-	-0.178	-0.229	-0.229

## 8/4 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は朝方▲0.055%～▲0.025%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。

## 8/4 の予定(国内)

岩田日銀副総裁が神奈川県金融経済懇談会であいさつ  
8:50 前週の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

## 8/4 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数  
欧 8月のECB月報  
英 BOE金融政策委員会の結果

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	▲18,600	2,952,600	+2,952,600	-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				
2016/8/1 ~ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	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				
2016/7/25 ~ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	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				
2016/7/19 ~ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	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				
2016/7/11 ~ 2016/7/25	8,000	2,690	2,690	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				
2016/7/8 ~ 2016/10/18	15,000	50	50	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/7/5 ~ 2016/10/14	15,000	60	60	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				
2016/7/4 ~ 2016/7/19	8,000	2,830	2,830	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				
2016/7/1 ~ 2016/10/11	15,000	70	70	0.00%	固定金利	-	札割れ	7/28 ~ 8/4	担保範囲内	130	130	0.870%	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