

# DAILY SIGNAL

平成29年8月2日(水)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## 8/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは317兆8,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は▲0.06%の出合から始まった。その後は、昨日に比べ▲0.05%台のビットが厚く、主に▲0.075～▲0.045%の水準で出合が見られた。  
後場に入っても出合の水準は変わらず、調整程度の出合が見られて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,178,000	3,178,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/2 のオペ結果
	8/2(水)		8/3(木)		8/4(金)		8/7(月)		
券	+300		▲500		▲1,000		+1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲63,500		▲16,800		+3,000		▲7,000		10:10 国債買入(8/4-)
過不足	▲63,200		▲17,300		+2,000		▲6,000		(残存1年超3年以下)
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	▲0.006% 按分(55%) 2,805億
国債買入		+3,400				+10,800			(残存3年超5年以下)
国庫短期証券買入									▲0.002% 按分(7.9%) 3,305億
国債買現先									(残存5年超10年以下)
国債売現先									▲0.001% 按分(61.2%) 4,707億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									
CP等買入				▲200					12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		+400							
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	▲59,400		▲17,500		+12,800		▲7,300		
当座預金残高	3,581,600		3,564,100		3,576,900		3,569,600		
準備預金残高	3,176,000		3,176,000		3,176,000		3,176,000		
積み終了先	3,175,600		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 3,181
超過準備	3,175,600								国債買現先 0
非準備先残高	405,600								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.8%								成長基盤強化 88,941
平均	58.1%		予想込増減 ▲17,500		予想込増減 +12,800		予想込増減 +700		被災地金融機関支援 5,205
乖離率	41.7%		当預見込 3,564,100		当預見込 3,576,900		当預見込 3,577,600		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,996,200  
8/3以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,100  
8/3以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	T/N	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.050	-	-0.100	-0.095
ビット	-0.065	-	0.000	-0.080
出来値	-	-	-	-

8/1 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,695,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	7/31
長期国債	282	361	398
CP等	2.2	2.3	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	14.7
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	506
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	363
その他とも負債・純資産計	383	476	506

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
7/27	698 (3M)	-0.1202%	-0.1230%
7/19	697 (3M)	-0.1082%	-0.1106%
7/18	696 (1Y)	-0.1138%	-0.1158%

8/1 のコール市場残高(前日比)

	合計	90,933	+2,205
有担	21,277	-3,206	
無担	69,656	+5,411	

\*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	-0.086	-	-	-0.045	-0.045	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.040	0.010	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.063	-	-	-0.044	-0.020	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.084	-0.086	-	-0.092	-0.093	-0.097	-0.101	-	-0.110	-0.123	-0.150

## 8/3 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.086～+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。

## 8/3 の予定(国内)

内閣改造・自民党役員人事

## 8/3 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数  
7月のISM非製造業指数  
欧 ECB経済報告

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	▲17,500	3,564,100	+3,564,100	-0.086	-0.050	-0.050	-0.045	-0.045	-0.040	-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	按分レド	*当日物		
					平均レド	按分率	倍率
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
2017/6/26 ~ 2017/7/10	8,000	1,310	1,310	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/6/19 ~ 2017/7/3	8,000	1,790	1,790	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	按分レド	*当日物		
					平均レド	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	按分レド	平均レド	按分率	倍率
8/3 ~ 8/10	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
7/27 ~ 8/3	担保範囲内	0	0	1.650%	固定金利	0.0%	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