

DAILY SIGNAL

平成29年8月4日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/4 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは319兆5,000億円だった。
週末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。前日に比べ調達需要が強く、主に▲0.07～▲0.04%の水準で取引されたが一部、▲0.03%台での出合も見られた。
調達一巡後は、ビットが薄く▲0.08%近辺での出合が散見されて引けた。
同加重平均金利は前営業日対比+0.003%と▲0.054%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	3,195,000	3,195,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/4 のオペ結果
	8/4(金)		8/7(月)		8/8(火)		8/9(水)		
券	▲300		+600		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ 10:10 国庫短期証券買入(8/8-) +0.000% 按分(40.5%) 5,003億 国債買入(8/8-) (残存1年超3年以下) +0.001% 按分(25.4%) 2,801億 (残存3年超5年以下) +0.002% 按分(38.2%) 3,304億 (残存10年超25年以下) +0.000% 按分(29.2%) 2,002億 (残存25年超) ▲0.002% 按分(34.8%) 1,003億 11:50 国債補完供給(8/4-8/7) ▲0.600% 全取 105億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
財政	+1,300		▲8,700		+2,000		+0		
過不足	+1,000		▲8,100		+2,000		▲1,000		
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		+10,900				+9,100			
国庫短期証券買入						+5,000			
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)			▲1,300	+1,300					
共通担保(全店)									
CP買現先			▲500						
CP等買入	▲300		▲100						
社債等買入									
ETF買入		+700		+500					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		▲100	+100						
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	+12,200		▲8,100		+16,100		▲1,000		
当座預金残高	3,576,400		3,568,300		3,584,400		3,583,400		
準備預金残高	3,191,400		3,190,900		3,190,900		3,190,900		
積み終了先	3,190,900		3,190,900		3,190,900		3,190,900		
超過準備	3,190,900		3,190,900		3,190,900		3,190,900		
非準備先残高	385,000		385,000		385,000		385,000		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	71.0%		71.0%		71.0%		71.0%		
乖離率	28.9%		28.9%		28.9%		28.9%		
共通担保オペ当社予想	ノーマル		ノーマル		ノーマル		ノーマル		
共通担保(全店)	3,181		3,181		3,181		3,181		
国債買現先	0		0		0		0		
CP買現先	0		0		0		0		
成長基盤強化	88,941		88,941		88,941		88,941		
被災地金融機関支援	5,205		5,205		5,205		5,205		
ロンハート残高	0		0		0		0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,996,200
8/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,200
8/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.045	-0.100
レボ	-0.050	0.000
ビット	-0.050	-0.070
出来値	-	-

(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
8/3	699 (3M)	-0.1142%	-0.1178%
7/27	698 (3M)	-0.1202%	-0.1230%
7/19	697 (3M)	-0.1082%	-0.1106%

8/3 のコール市場残高(前日比)

	合計	86,176	-5,088
有担	22,616	+1,298	
無担	63,560	-6,386	

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

8/3 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,618,700

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	-	-	-0.040	-0.035	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.030	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-	-	-0.036	-0.023	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.083	-0.078	-	-0.090	-0.091	-0.096	-0.100	-	-0.109	-0.123	-0.150

8/7 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。
共通担保オペはノーオペを予想。

8/7 の予定(国内)

14:00 6月の景気動向指数速報(内閣府)
6月の消費活動指数(日銀)

8/7 の予定(海外)

米 FRBの7月の労働市場情勢指数
セントリス連銀総裁の講演
ミアホリス連銀総裁の講演

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	▲8,100	3,568,300	+3,568,300	-0.086	-0.045	-0.045	-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	按分レト	平均レト	按分率	倍率
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
2017/6/26 ~ 2017/7/10	8,000	1,310	1,310	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

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