

# DAILY SIGNAL

平成29年8月10日(木)  
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320兆5,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は▲0.03%の出合から始まった。その後は主に▲0.035~▲0.015%の水準で取引が見られた。積み最終日が近付いていることに加えて4日積みとなることもあり、より調達意欲が強まる展開で、同加重平均金利は前営業日対比0.005%上昇の▲0.028%と、およそ5ヶ月ぶりに△0.02%台となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	3,205,000	3,205,000

(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(木)		8/14(月)		8/15(火)		8/16(水)		
券	▲1,300		+700		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲2,800		▲7,500		+53,000		+1,000		10:10 国庫短期証券買入(8/15-)
過不足	▲4,100		▲6,800		+53,000		+1,000		▲0.004%按分(90.6%) 7,500億
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				+8,100		+7,400			(残存1年以下)
国庫短期証券買入						+7,500			+0.003% 按分(36.0%) 1,005億
国債買現先									(残存1年超3年以下)
国債売現先									+0.005% 按分(74.3%) 2,803億
共通担保(本店)			▲1,500	+1,500					(残存3年超5年以下)
共通担保(全店)									+0.003% 按分(4.9%) 3,304億
CP買現先									(物価連動債)
CP等買入	▲900		▲400	+3,000					▲0.130円 按分(45.7%) 251億
社債等買入									11:50
ETF買入		+100							ノーオペ
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+300								ノーオペ
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	▲4,600		+3,900		+67,900		+1,000		
当座預金残高	3,572,000		3,575,900		3,643,800		3,644,800		
準備預金残高	3,204,900		3,204,300		ノ－オペ		ノ－オペ		共通担保(全店) 3,180
積み終了先	ノ－オペ		ノ－オペ		ノ－オペ		ノ－オペ		国債買現先 0
超過準備	3,204,300		ノ－オペ		ノ－オペ		ノ－オペ		CP買現先 0
非準備先残高	367,100		ノ－オペ		ノ－オペ		ノ－オペ		成長基盤強化 88,941
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		被災地金融機関支援 5,205
平均	93.5%		93.5%		93.5%		93.5%		ロンハート残高 0
乖離率	6.4%		6.4%		6.4%		6.4%		

今積み期間の所要準備額(積数) 3,008,500  
8/14以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 300  
8/14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
オファー	-0.020	-	-0.100 -0.085
ビッド	-0.035	-	0.000 -0.065
出来値	-	-	-

8/9 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,631,600

(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
8/9	701 (3M)	-0.1082%	-0.1110%
8/8	700 (6M)	-0.1131%	-0.1150%
8/3	699 (3M)	-0.1142%	-0.1178%

8/9 のコール市場残高(前日比)

合計	88,159	+2,326
有担	20,413	-485
無担	67,746	+2,811

\*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	-0.080	-	-	-0.035	-0.045	-0.015	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	0.001	0.000	-	-	-	-	-
加重平均	-0.028	-	-	-0.027	-0.034	-0.010	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.079	-0.075	-	-0.088	-0.091	-0.095	-0.099	-	-0.109	-0.122	-0.148

8/14 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.08~+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。

8/14 の予定(国内)

8:50 4~6月のGDP速報(内閣府)

8/14 の予定(海外)

ユーロ圏 6月の鉱工業生産

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	当残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	+3,900	3,575,900	+3,575,900	-0.080	-0.045	-0.045	-0.045	-0.040	-0.035	-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
2017/8/14 ~ 2017/8/28	8,000	1,530	1,530	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

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

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
8/10 ~ 8/17	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
8/3 ~ 8/10	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	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