

# DAILY SIGNAL

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

## 8/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは321兆6,000億円だった。  
無担保コールON物は▲0.05%の合出から始まった。  
その後は▲0.08～▲0.045%のレンジで取引された。  
また一部で試し取りの動きが見られ、0.001%での取引が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,216,000	3,216,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/29 のオペ結果
	8/29(火)		8/30(水)		8/31(木)		9/1(金)		
券	▲200		+200		▲1,000		+0		9:20
財政	▲900		+400		▲2,000		▲10,000		ノーオペ
過不足	▲1,100		+600		▲3,000		▲10,000		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	ノーオペ
国債買入		+5,200		+7,400					10:40
国庫短期証券買入		+2,500							米ドル資金供給(8/31-9/8)
国債買現先									貸付利率 1.650% 0百万米ドル
国債売現先									11:50
共通担保(本店)									国債補完供給(8/29-8/30)
共通担保(全店)									▲0.600% 全取 1億
CP買現先									12:50
CP等買入	▲500		▲100			+3,000			ノーオペ
社債等買入		+1,000							13:00
ETF買入									ノーオペ
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給									
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	+7,100		+7,900		+0		▲10,300		
当座預金残高	3,629,100		3,637,000		3,637,000		3,626,700		
準備預金残高	3,215,600		3,214,100		3,214,100		3,214,100		
積み終了先	3,214,100		3,214,100		3,214,100		3,214,100		
超過準備	3,214,100		3,214,100		3,214,100		3,214,100		
非準備先残高	413,500		413,500		413,500		413,500		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	45.2%		45.2%		45.2%		45.2%		
乖離率	54.7%		54.7%		54.7%		54.7%		
共通担保オペ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 3,773
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 88,941
									被災地金融機関支援 5,238
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,996,900  
8/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,400  
8/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.050	-	-0.100	-0.150
ビッド	-0.075	-	0.000	-0.100
出来値	-	-	-	-

8/28 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,677,400**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	8/20
長期国債	282	361	402
CP等	2.2	2.3	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	15.1
J-REIT	0.27	0.36	0.42
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	510
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	365
その他とも負債・純資産計	383	476	510

## T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
8/24	704 (3M)	-0.1423%	-0.1463%
8/17	703 (3M)	-0.1243%	-0.1275%
8/16	702 (1Y)	-0.1251%	-0.1281%

## 8/28 のコール市場残高(前日比)

	合計	平均利回
有担	96,076	-3.193
無担	22,434	+3.29
無担	73,642	-3.522

\*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	-0.085	-	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.057	-0.030	-	-0.041	-	-	0.005	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.097	-0.096	-	-0.106	-0.103	-0.105	-0.108	-	-0.115	-0.125	-0.154

## 8/30 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。

## 8/30 の予定(国内)

特になし

## 8/30 の予定(海外)

米 8月のADP雇用統計  
4～6月のGDP改定値  
週間のMBA住宅ローン申請指数

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	+7,900	3,637,000	+3,637,000	-0.086	-0.045	-0.045	-0.045	-0.045	-0.020	-0.020	-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	*当日物		
					平均レ	按分率	倍率
2017/8/28 ~ 2017/9/11	8,000	1,932	1,932	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/21 ~ 2017/9/4	8,000	1,451	1,451	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

## 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	*当日物		
					平均レ	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	平均レ	按分率	倍率
8/31 ~ 9/8	担保範囲内	0	0	1.650%	固定金利	0.0%	応れなし
8/24 ~ 8/31	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