

DAILY SIGNAL

8/31 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは322兆4,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.07%の出合から始まった。
その後は▲0.08～▲0.055%のレンジで取引された。
後場では▲0.08%台で調整程度の出合が見られた。

平成29年8月31日(木)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,224,000	3,224,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/31 のオペ結果
	8/31(木)		9/1(金)		9/4(月)		9/5(火)		9:20 ノーオペ
券	▲200		▲100		+1,000		+1,000		10:10 ノーオペ
財政	▲1,500		▲8,700		▲18,000		▲8,000		11:50 ノーオペ
過不足	▲1,700		▲8,800		▲17,000		▲7,000		国債補完供給(8/31-9/1) ▲0.600% 全取 103億
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	12:50 ノーオペ
国債買入				+7,700					13:00 共通担保(全店)<固定金利> (9/4-9/19) 0% 全取 1,360億
国庫短期証券買入									13:50 国債補完供給(8/31-9/1) ▲0.600% 全取 186億
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)					▲1,500	+1,400			
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲2,300	+3,000	▲200						
社債等買入			▲100						
ETF買入		+700							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		▲300	+300						
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援			▲4,000	+4,000					
貸出増加支援									
当座預金増減	▲600		▲1,100		▲17,100		▲7,000		
当座預金残高	3,636,100		3,635,000		3,617,900		3,610,900		
準備預金残高	3,223,800		3,223,300		3,223,300		3,223,300		共通担保(全店) 3,773
積み終了先	3,223,300		3,223,300		3,223,300		3,223,300		国債買現先 0
超過準備	3,223,300		3,223,300		3,223,300		3,223,300		CP買現先 0
非準備先残高	412,300		412,300		412,300		412,300		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 5,238
平均	51.6%		51.6%		51.6%		51.6%		ロンハート残高 0
乖離率	48.3%		48.3%		48.3%		48.3%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,994,300
9/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,800
9/1 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	-0.050	-	-0.100	-0.105
ビッド	-0.075	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

8/30 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,692,300

(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
8/31	705 (3M)	-0.1683%	-0.1760%
8/24	704 (3M)	-0.1423%	-0.1463%
8/17	703 (3M)	-0.1243%	-0.1275%

8/30 のコール市場残高(前日比)

合計	90,137	-5,837
有担	23,089	+268
無担	67,048	-6,105

*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	-0.040	-	-	-0.045	-0.035	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.025	-	-	-0.010	-0.020	-	-	-	-	-
加重平均	-0.066	-0.032	-	-	-0.039	-0.028	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.098	-0.099	-	-0.102	-0.102	-0.103	-0.125	-	-0.120	-0.127	-0.154

9/1 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。

9/1 の予定(国内)

8:50 4～6月の法人企業統計(財務省)
16:00 8月調査の債券市場サーベイ(日銀)

9/1 の予定(海外)

米 8月の雇用統計
8月のISM製造業指数
欧 8月の製造業PMI確報

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
◎ ノーオペ	▲1,100	3,635,000	+3,635,000	-0.086	-0.045	-0.045	-0.045	-0.035	-0.020	-0.020	-0.010
				～	～	～	～	～	～	～	～
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.080

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
2017/9/4 ～ 2017/9/19	8,000	1,360	1,360	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

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
8/31 ～ 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