

DAILY SIGNAL

平成29年8月1日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは323兆1,000億円だった。
8月初営業日となる本日の無担保コールON物は▲0.06%の割合から始まった。
その後は、主に▲0.08～▲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	-	-	3,231,000	3,231,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/1 のオペ結果
	8/1(火)		8/2(水)		8/3(木)		8/4(金)		
券	+0		+200		+0		▲1,000		9:20 ノオベ
財政	▲3,800		▲62,400		▲23,000		+3,000		10:10 ノオベ
過不足	▲3,800		▲62,200		▲23,000		+2,000		10:40 ノオベ
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	10:40 米ドル資金供給(8/3-8/10) 貸付利率 1.660% 1百万米ドル
国債買入		+10,900		+3,400					11:50 国債補完供給(8/1-8/2) ▲0.600% 全取 379億
国庫短期証券買入		+5,000							12:50 ノオベ
国債買現先									13:00 ノオベ
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲100								
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+100	▲400	+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	+11,700		▲58,400		▲23,000		+2,000		
当座預金残高	3,641,000		3,582,600		3,559,600		3,561,600		
準備預金残高	3,238,200		3,237,600		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 3,181
積み終了先	3,237,600		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0
超過準備	3,237,600		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0
非準備先残高	402,800		ノオベ		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化 88,941
準備預金進捗率	99.8%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		被災地金融機関支援 5,205
平均	54.8%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		ロンハート残高 0
乖離率	44.9%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		

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

	T/N	ユーロ円	T+2
無担	-	-	-
CP現先	-0.100	-	-0.105
レボG.C	-	-	-
オファー	-0.050	-	-0.100
ビッド	-0.065	-	0.000
出来値	-	-	-

7/31 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,683,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	7/20
長期国債	282	361	396
CP等	2.2	2.3	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	14.5
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	32
その他とも資産計	383	476	503
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	358
その他とも負債・純資産計	383	476	503

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%

7/31のコール市場残高(前日比)

	合計	88,728	-3,495
有担	24,483	+3,100	
無担	64,245	-6,595	

*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	-	-	-0.050	-0.050	-	-0.014	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-0.015	-	0.001	-	-	-	-
加重平均	-0.063	-	-	-0.035	-0.036	-	-0.007	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.083	-0.088	-	-0.091	-0.092	-0.097	-0.101	-	-0.109	-0.123	-0.150

8/2 オファ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。
共通担保オペはノオペを予想。

8/2の予定(国内)

8:50 7月のマネタリベース
10:00 7月31現在の営業毎旬報告(日銀)
布野審議委員が札幌市金融経済懇話会に出席・会見

8/2の予定(海外)

米 7月のADP雇用統計
サンフランシスコ連銀総裁の講演
欧 6月の生産者物価

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
◎ ノオベ	▲58,400	3,582,600	+3,582,600	-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	按分レト	*当日物		
					平均レト	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	按分レト	*当日物		
					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
8/3 ~ 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