

# DAILY SIGNAL

平成28年8月4日(木)  
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220兆1,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%で出合いからスタート。  
その後は▲0.065%～▲0.03%のレンジで取引され、  
後場ではほとんど出合いが見られず、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	-	-	2,201,000	+2,201,000

(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(木)		8/5(金)		8/8(月)		8/9(火)		
券	+100		+0		+1,000		+0		9:20
財政	▲20,300		+3,300		▲5,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲20,200		+3,300		▲4,000		+2,000		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				+8,000					10:40
国庫短期証券買入									CP等買入(8/9-)
国債買現先									▲0.001%按分(10.7%) 3,476億
共通担保(本店)					▲4,800	+2,000	▲100		11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(8/4-8/5)
CP買現先									▲0.500% 全取 1,092億
CP等買入	▲100		▲600						12:50
社債等買入			▲100						ノーオペ
ETF買入									13:00
J-REIT買入		+100							共通担保(全店)(固定金利)
被災地金融機関支援									(8/8-8/22)
貸出									0% 全取 2,040億
国債補完供給	+500	▲1,200	+1,200						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲20,900		+11,800		▲6,800		+5,400		
当座預金残高	2,950,300		2,962,100		2,955,300		2,960,700		
準備預金残高	2,654,000								共通担保(本店)
積み終了先	2,198,400		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +5,000		共通担保(全店) 10,250
超過準備	2,198,400								国債買現先
非準備先残高	296,300								CP買現先
準備預金進捗率	99.8%								成長基盤強化
平均	64.5%		予想込増減 +11,800		予想込増減 ▲6,800		予想込増減 +10,400		被災地金融機関支援
乖離率	35.3%		当預見込 2,962,100		当預見込 2,955,300		当預見込 2,965,700		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,139,400  
8/5以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,500  
8/5以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.010	-0.100
レボ	-0.050	0.000
ビッド	-	-0.065
出来値	-	-

8/3 時点のマナタリーベース(単位:億円) 3,980,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	7/31
長期国債	202	282	332
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	8.7
J-REIT	0.18	0.27	0.32
貸出支援基金	25	31	33
国庫短期証券	49	43	55
その他とも資産計	300	383	443
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	303
その他とも負債・純資産計	300	383	443

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
8/4	624(3M)	-0.1844%	-0.2100%
7/28	623(3M)	-0.2745%	-0.2933%
7/21	622(3M)	-0.2505%	-0.2685%

8/3のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
8/3	79,622	+522	-647
8/4	18,924	-647	+1,169

\*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	-0.075	-0.030	-	-0.025	-	-	0.001	-	-	-	-
最高	0.001	-0.010	-	0.050	-	-	0.010	-	-	-	-
加重平均	-0.038	-0.029	-	-0.009	-	0.060	0.002	-	-	-	-
東京レボレート	-0.082	-0.078	-	-0.087	-0.092	-0.096	-0.102	-	-0.174	-0.229	-0.230

## 8/5 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は朝方▲0.055%～▲0.02%で取引されよう。  
共通担保オペは期落ち分は低調な応札が続いていたこと  
から減額してオファーされると予想。

## 8/5 の予定(国内)

9:00 6月の毎月勤労統計速報(厚労省)  
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)

## 8/5 の予定(海外)

米 7月の雇用統計  
6月の貿易収支

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	S1Y
◎	ノーオペ	+11,800	2,962,100	+2,962,100	-0.080	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.070	-0.070
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

### 共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/8/8 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/1 ~ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/25 ~ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/19 ~ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/11 ~ 2016/7/25	8,000	2,690	2,690	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/8 ~ 2016/10/18	15,000	50	50	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/5 ~ 2016/10/14	15,000	60	60	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/4 ~ 2016/7/19	8,000	2,830	2,830	0.00%	固定金利	- 札割れ

### \*当日物

### 共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
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%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

### 米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
8/4 ~ 8/12	担保範囲内	0	0	0.890%	固定金利	- 応札なし
7/28 ~ 8/4	担保範囲内	130	130	0.870%	固定金利	- 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ありません。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