

DAILY SIGNAL

平成28年7月5日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/5 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは227兆円だった。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.04%の出合から始まり、一部で▲0.03%台の出合いも見られた。その後は▲0.075%～▲0.04%のレンジで取引され、後場では出合いはほとんど見られなかった。ターム物は今積み期内の取引が散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,270,000	+2,270,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/5 のオペ結果
	7/5(火)		7/6(水)		7/7(木)		7/8(金)		
券	+1,000		+500		+0		+0		9:20
財政	+9,400		▲1,500		▲28,000		+1,000		ノーオペ
過不足	+10,400		▲1,000		▲28,000		+1,000		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		+12,700		+4,400					11:50
国庫短期証券買入		+20,000							国債補完供給(7/5-7/6)
国債買現先									▲0.600%全取 99億
共通担保(本店)	▲600	+100							12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲400						ノーオペ
社債等買入									13:50
ETF買入		+100		+300					国債補完供給(7/5-7/6)
J-REIT買入									▲0.600%全取 20億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+100	▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+42,500		+3,400		▲28,000		+400		
当座預金残高	3,050,200		3,053,600		3,025,600		3,026,000		
準備預金残高	2,746,100								
積み終了先	2,270,800								共通担保(本店) 0
超過準備	2,270,800								共通担保(全店) 7,820
非準備先残高	304,100								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	66.7%		予想込増減 +3,400		予想込増減 ▲28,000		予想込増減 +15,400		成長基盤強化 68,139
乖離率	33.2%		当預見込 3,053,600		当預見込 3,025,600		当預見込 3,041,000		被災地金融機関支援 4,581
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064.300
7/6以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,000
7/6以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.030	-	-0.100	-0.095
ビッド	-	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

7/4 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,014,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	6/30
長期国債	202	282	324
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	8.5
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	53
その他とも資産計	300	383	433
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	433

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
6/30	617(3M)	-0.2905%	-0.2957%
6/23	616(3M)	-0.2224%	-0.2441%
6/15	615(3M)	-0.2517%	-0.2636%

7/4 のコール市場残高(前日比)		
	合計	前日比
有担	69,151	-8,335
無担	20,027	-390
無担	49,124	-7,945

*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	-0.078	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.005	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-0.040	-	-0.029	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.083	-0.088	-	-0.096	-0.101	-0.106	-0.115	-	-0.209	-0.230	-0.231

§ 7/6 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.08～▲0.03%で取引されよう。
共通担保オペは期落ち分15,000億円がロールオファーされよう。

7/6 の予定(国内)

14.00 5月の基調的なインフレ率を補足するための指標(日銀)

7/6 の予定(海外)

米 6月14～15日のFOMC議事録
5月の貿易収支
6月のISM非製造業指数

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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	+3,400	3,053,600	+3,053,600	-0.080	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.070	-0.070
				0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000

共通担保資金供給(全店)				*当日物				共通担保資金供給(本店)				*当日物			
期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/7/5 ~ 2016/10/14	15,000	60	60	0.00%	固定金利	-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2016/7/4 ~ 2016/7/19	8,000	2,830	2,830	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2016/7/1 ~ 2016/10/11	15,000	70	70	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2016/6/28 ~ 2016/10/7	15,000	50	50	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2016/6/27 ~ 2016/7/11	8,000	4,130	4,130	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/6/20 ~ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/6/13 ~ 2016/6/27	8,000	2,081	2,081	0.00%	固定金利	-	札割れ	6/30 ~ 7/8	担保範囲内	1,475	1,475	0.870%	固定金利	-	1.00
2016/6/6 ~ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	0.00%	固定金利	-	札割れ	6/23 ~ 6/30	担保範囲内	2	2	0.880%	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