

DAILY SIGNAL

平成28年7月4日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/4 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは223兆9,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.04%の出合からスタート。
その後は、▲0.075～▲0.04%のレンジで推移した。
本日発表の日銀短観によると企業物価見通しは、1年後の平均値が0.7%上昇と
前回調査(3月、0.8%上昇)から0.1%ポイント低下した。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,239,000	+2,239,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/4 のオペ結果
	7/4(月)		7/5(火)		7/6(水)		7/7(木)		
券	+800		+800		+0		+0		9:20
財政	▲34,300		+8,000		+2,000		▲24,000		ノーオペ
過不足	▲33,500		+8,800		+2,000		▲24,000		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	国債買入(7/6-)
国債買入				+12,700		+3,900			(残存1年以下)
国庫短期証券買入				+20,000					+0.010%按分(25.5%) 701億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									▲0.008%按分(67.4%) 2,004億
共通担保(全店)	▲4,200	+2,800	▲600	+100					(残存25年超)
CP買現先									▲0.036%按分(70.3%) 1,200億
CP等買入	▲100		▲200						11:50
社債等買入				+100					国債補完供給(7/4-7/5)
ETF買入									▲0.60%全取 67億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給		▲100	+100						ノーオペ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲35,100		+41,000		+5,900		▲24,000		
当座預金残高	3,007,700		3,048,700		3,054,600		3,030,600		
準備預金残高	2,714,100		2,714,100		2,714,100		2,714,100		
積み終了先	2,238,200		2,238,200		2,238,200		2,238,200		共通担保(本店)
超過準備	2,238,200		2,238,200		2,238,200		2,238,200		共通担保(全店)
非準備先残高	293,600		293,600		293,600		293,600		国債買現先
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先
平均	63.3%		63.3%		63.3%		63.3%		成長基盤強化
乖離率	36.6%		36.6%		36.6%		36.6%		被災地金融機関支援
			予想込増減	+41,000	予想込増減	+5,900	予想込増減	▲24,000	ロンハート残高
			当預見込	3,048,700	当預見込	3,054,600	当預見込	3,030,600	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064.300
7/5 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 1,500
7/5 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
レボ	-	-0.100
ビッド	-	0.000
出来値	-	-0.090

7/1 時点のマナターベース(単位:億円) 4,050,300

(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%

7/1 のコール市場残高(前日比)		
合計	77,486	+18,819
有担	20,417	+4,783
無担	57,069	+14,036

*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	-	-	-0.045	-0.060	-	-	-	-	-	-
最高	0.000	-	-	-0.030	-0.040	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.057	-0.030	-	-0.040	-0.047	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.081	-0.090	-	-0.098	-0.101	-0.106	-0.115	-	-0.205	-0.227	-0.233

§ 7/5 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.085～▲0.03%で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

7/5 の予定(国内)

8:50 7月の当座預金増減要因見込み(日銀)
14:00 需給ギャップと潜在成長率(日銀)

7/5 の予定(海外)

米 5月の製造業受注
ニューヨーク連銀総裁講演

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	+41,000	3,048,700	+3,048,700	-0.085	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
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
2016/7/1 ~ 2016/10/11	15,000	70	70	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/6/28 ~ 2016/10/7	15,000	50	50	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/6/27 ~ 2016/7/11	8,000	4,130	4,130	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/6/20 ~ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/6/13 ~ 2016/6/27	8,000	2,081	2,081	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/6/6 ~ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	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
6/30 ~ 7/8	担保範囲内	1,475	1,475	0.870%	固定金利	- 1.00
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