

DAILY SIGNAL

平成28年7月6日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/6 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%のレンジで出合いが見られた。
ターム物は今積み期内の期間で出合いが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,279,000	+2,279,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/6 のオペ結果
	7/6(水)		7/7(木)		7/8(金)		7/11(月)		
券	+400		▲300		+0		+1,000		9:20
財政	▲1,100		▲22,200		+1,000		▲53,000		ノーオペ
過不足	▲700		▲22,500		+1,000		▲52,000		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(7/8-)
国債買入		+4,400				+12,700			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									▲0.011%按分(96.6%) 3,751億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)					▲600	+100	▲4,100		▲0.015%按分(38.1%) 4,402億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.037%按分(44.2%) 4,302億
CP等買入	▲400		▲200						(物価連動債)
社債等買入									▲1.100円(7.6%) 251億
ETF買入		+300							10:40
J-REIT買入									米ドル資金供給(7/8-7/14)
被災地金融機関支援貸出									貸付金利0.890% 220百万米ドル
国債補完供給	+100	▲100	+100						11:50
成長基盤強化支援貸出増加支援									国債補完供給(7/6-7/7)
									▲0.600%全取 73億
									12:50
									ノーオペ
									13:00
									共通担保(全店)固定金利
									(7/8-10/18)
									0%全取 50億
当座預金増減	+3,600		▲22,600		+13,200		▲56,100		共通担保(本店)
当座預金残高	3,053,800		3,031,200		3,044,400		2,988,300		共通担保(全店)
準備預金残高	2,754,300		2,780,000						共通担保(全店)
積み終了先	2,278,000		ノーオペ		共通担保オベ当社予想		共通担保(全店) +8,000		0
超過準備	2,277,800								7,820
非準備先残高	299,500								国債買現先
準備預金進捗率	99.9%								0
平均	70.0%		予想込増減 ▲22,600		予想込増減 +13,200		予想込増減 ▲48,100		CP買現先
乖離率	29.9%		当預見込 3,031,200		当預見込 3,044,400		当預見込 2,996,300		0
									成長基盤強化
									68,139
									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
7/7以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 600
7/7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	-	-0.095
ビッド	-	0.000
レボ	-	-0.080
出来値	-	-

7/5 時点のマナターベース(単位:億円) 4,055,900

(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
7/6	618(6M)	-0.3722%	-0.3939%
6/30	617(3M)	-0.2905%	-0.2957%
6/23	616(3M)	-0.2224%	-0.2441%

7/5のコール市場残高(前日比)

	合計	75,042	+5,891
有担	20,060	+33	
無担	54,982	+5,858	

*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	-0.100	-0.040	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.020	0.000	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.056	-0.028	-	0.000	0.010	-	-0.040	-	-	-	-
東京レボレート	-0.085	-0.087	-	-0.097	-0.101	-0.106	-0.120	-	-0.215	-0.231	-0.233

§ 7/7 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。
共通担保オベは期落ち分8,000億円がロールオファーされると予想する。

7/7の予定(国内)

日銀支店長会議・黒田総裁あいさつ
8:50 6月末の外貨準備等の状況(財務省)
14:00 地域経済報告[さくらレポート](日銀)

7/7の予定(海外)

米 6月のADP雇用統計
週間の新規失業保険申請件数
欧 6月のECB理事会の議事要旨

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	▲22,600	3,031,200	+3,031,200	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/7/8 ~ 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
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

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%

米ドル資金供給オベ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
7/8 ~ 7/14	担保範囲内	220	220	0.890%	固定金利	- 1.00
6/30 ~ 7/8	担保範囲内	1,475	1,475	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