

DAILY SIGNAL

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

§ 7/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは226兆5,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.04%の出合いから始まった。
その後は▲0.075%～▲0.04%のレンジで出合った。
本日公表されたコール市場残高によると、6月の無担保コール市場平残は5兆1,507億円となり、2016年2月以来4か月ぶりの5兆円越えとなった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,265,000	+2,265,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/7 のオペ結果
	7/7(木)		7/8(金)		7/11(月)		7/12(火)		
券	▲100		▲600		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲20,500		+2,400		▲53,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲20,600		+1,800		▲52,000		+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				+13,100					10:40
国庫短期証券買入									CP等買入(7/12-)
国債買現先									▲0.001%按分(21.4%) 3,491億
共通担保(本店)			▲600	+100	▲4,100	+2,700	0		11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(7/7-7/8)
CP買現先									▲0.600%全取 88億
CP等買入	▲200		▲400						12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入				+800					13:00
J-REIT買入									共通担保(全店)×(固定金利)
被災地金融機関支援									(7/11-7/25)
貸出									0%全取 2,690億
国債補完供給	+100	▲100	+100						13:50
成長基盤強化支援									国債補完供給(7/7-7/8)
貸出増加支援									▲0.600%全取 27億
当座預金増減	▲20,800		+14,900		▲53,400		+5,500		
当座預金残高	3,033,000		3,047,900		2,994,500		3,000,000		
準備預金残高	2,740,100								
積み終了先			ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店)
超過準備	2,265,500								共通担保(全店)
非準備先残高	292,900								国債買現先
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先
平均	73.3%		予想込増減 +14,900		予想込増減 ▲53,400		予想込増減 +5,500		成長基盤強化
乖離率	26.6%		当預見込 3,047,900		当預見込 2,994,500		当預見込 3,000,000		被災地金融機関支援
									ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,076,200
7/8以降の残り積み立て額(残り所要)積数 700
7/8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	-	0.000
レボ	-	-0.055
出来値	-	-

7/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,059,100

(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	回数	最高利回	平均利回
7/7	619(3M)	-0.3032%	-0.3234%
7/6	618(6M)	-0.3722%	-0.3939%
6/30	617(3M)	-0.2905%	-0.2957%

7/6のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
7/6	71,103	18,810	-2,689
7/5	18,810	-1,250	-
7/4	52,293	-	-

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.055	-0.040	-	-0.050	0.080	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.084	-0.077	-	-0.096	-0.100	-0.109	-0.120	-	-0.217	-0.230	-0.235

§ 7/8 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。
12日は共通担保オペ(1兆5,000億円オファー、応札なし)の
エンド日であるが、ノーオペを予想する。

7/8 の予定(国内)

8:50 5月の国際収支(財務省)
9:00 5月の毎月勤労統計速報(厚労省)
14:00 6月の景気ウォッチャー調査(内閣府)

7/8 の予定(海外)

米 6月の雇用統計

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	+14,900	3,047,900	+3,047,900	-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
2016/7/11 ~ 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
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

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
7/8 ~ 7/14	220	220	220	0.890%	固定金利	- 1.00
6/30 ~ 7/8	1,475	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