

# DAILY SIGNAL

平成28年7月8日(金)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 7/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは228兆3,000億円だった。  
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▲0.06%で大きく出合いが見られ、一日を通して▲0.075%～▲0.04%のレンジで推移した。本日のT+2は共通担保オペ(15,000億円、応札無、4/1～7/12)の終日であったが、ロールオフはされなかった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,283,000	+2,283,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/8 のオペ結果
	7/8(金)		7/11(月)		7/12(火)		7/13(水)		
券	▲500		+1,100		+1,000		+0		9:20 ノーオペ
財政	+3,700		▲60,300		+1,000		▲17,000		10:10 国庫短期証券買入(7/12-)
過不足	+3,200		▲59,200		+2,000		▲17,000		0.019%按分(79.2%) 30,000億
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(7/12-)
国債買入		+13,100				+11,400			▲0.029%按分(42.2%) 3,751億
国庫短期証券買入						+30,000			(残存1年超3年以下)
国債買現先									▲0.005%按分(22.1%) 4,402億
共通担保(本店)	▲600	+100	▲4,100	+2,700					(残存3年超5年以下)
共通担保(全店)									▲0.002%按分(40.4%) 2,001億
CP買現先						+3,500			(残存10年超25年以下)
CP等買入	▲400		▲600						+0.002%按分(25.5%) 1,205億
社債等買入				+100					(残存25年超)
ETF買入		+800							+0.003%按分(78.3%) 1,205億
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(7/8-7/11)
貸出									▲0.600%全取 188億
国債補完供給	+100	▲200	+200						12:50
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									13:00
									ノーオペ
									13:50
当座預金増減	+16,100		▲60,900		+46,900		▲17,000		国債補完供給(7/8-7/11)
当座預金残高	3,049,100		2,988,200		3,035,100		3,018,100		▲0.600%全取 17億
準備預金残高	2,758,700		2,283,000		2,283,000		2,283,000		共通担保(本店)
積み終了先	2,283,000		2,283,000		2,283,000		2,283,000		共通担保(全店)
超過準備	2,282,900		2,282,900		2,282,900		2,282,900		0
非準備先残高	290,400		290,400		290,400		290,400		国債買現先
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		0
平均	83.3%		83.3%		83.3%		83.3%		CP買現先
乖離率	16.6%		16.6%		16.6%		16.6%		0
			予想込増減	▲60,900	予想込増減	+46,900	予想込増減	▲17,000	成長基盤強化
			当預見込	2,988,200	当預見込	3,035,100	当預見込	3,018,100	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) 2,076,200  
7/11 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 400  
7/11 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G.C	-	-0.090
ビッド	-	0.000
レボG.C	-	-0.075
出来値	-	-

7/7 時点のマナタリーベース(単位:億円) **4,038,500**

(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
7/7	619(3M)	-0.3032%	-0.3234%
7/6	618(6M)	-0.3722%	-0.3939%
6/30	617(3M)	-0.2905%	-0.2957%

## 7/7 のコール市場残高(前日比)

	合計	67,023	-4,080
有担	19,391	+581	
無担	47,632	-4,661	

\*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.000	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	-0.025	-	-0.030	-0.003	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.076	-0.053	-	-0.097	-0.100	-0.111	-0.121	-	-0.212	-0.231	-0.235

## § 7/11 オファーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は▲0.08～▲0.03%で取引されよう。8:50 6月のマネーストック(日銀) 5月の機械受注(内閣府)

## 7/11 の予定(国内)

## 7/11 の予定(海外)

米 FRBの6月労働市場情勢指数  
カンザシティ連銀総裁の講演

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	▲60,900	2,988,200	+2,988,200	-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)					*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				
2016/7/11 ~ 2016/7/25	8,000	2,690	2,690	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				
2016/7/8 ~ 2016/10/18	15,000	50	50	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				
2016/7/5 ~ 2016/10/14	15,000	60	60	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				
2016/7/4 ~ 2016/7/19	8,000	2,830	2,830	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				
2016/7/1 ~ 2016/10/11	15,000	70	70	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/6/28 ~ 2016/10/7	15,000	50	50	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				
2016/6/27 ~ 2016/7/11	8,000	4,130	4,130	0.00%	固定金利	-	札割れ	7/8 ~ 7/14	担保範囲内	220	220	0.890%	固定金利	-	1.00				
2016/6/20 ~ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	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				

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