

DAILY SIGNAL

平成28年7月12日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは227兆4,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.04%の出合から始まり、
その後は▲0.075%～▲0.035%のレンジで取引された。調達一巡後も
地合に変化は見られず、後場にかけて調整程度の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,274,000	+2,274,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/12 のオペ結果
	7/12(火)		7/13(水)		7/14(木)		7/15(金)		
券	+500		+500		▲1,000		▲2,000		9:20 ノーオペ
財政	▲6,000		▲15,500		▲8,000		▲11,000		10:40 米ドル資金供給(7/14-7/21)
過不足	▲5,500		▲15,000		▲9,000		▲13,000		貸付金利0.890% 180百万米ドル
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	11:50 国債補完供給(7/12-7/13)
国債買入		+11,900							▲0.600%全取 2,958億
国庫短期証券買入		+30,000							
国債買現先									12:50 ノーオペ
共通担保(本店)									13:00 ノーオペ
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲600	+3,500	▲100						
社債等買入	▲100								
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲3,000	+3,000						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+36,400		▲12,100		▲9,000		▲13,000		
当座預金残高	3,025,100		3,013,000		3,004,000		2,991,000		
準備預金残高	2,735,600		2,735,600		2,735,600		2,735,600		共通担保(本店) 0
積み終了先	2,261,900		2,261,900		2,261,900		2,261,900		共通担保(全店) 5,880
超過準備	2,261,800		2,261,800		2,261,800		2,261,800		国債買現先 0
非準備先残高	289,500		289,500		289,500		289,500		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化 68,139
平均	90.0%		90.0%		90.0%		90.0%		被災地金融機関支援 4,581
乖離率	9.9%		9.9%		9.9%		9.9%		ロンハート残高 0
当座預金増減	+36,400		▲12,100		▲9,000		▲13,000		
当座預金残高	3,025,100		3,013,000		3,004,000		2,991,000		
準備預金残高	2,735,600		2,735,600		2,735,600		2,735,600		
積み終了先	2,261,900		2,261,900		2,261,900		2,261,900		
超過準備	2,261,800		2,261,800		2,261,800		2,261,800		
非準備先残高	289,500		289,500		289,500		289,500		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	90.0%		90.0%		90.0%		90.0%		
乖離率	9.9%		9.9%		9.9%		9.9%		
当座預金増減	+36,400		▲12,100		▲9,000		▲13,000		
当座預金残高	3,025,100		3,013,000		3,004,000		2,991,000		
準備預金残高	2,735,600		2,735,600		2,735,600		2,735,600		
積み終了先	2,261,900		2,261,900		2,261,900		2,261,900		
超過準備	2,261,800		2,261,800		2,261,800		2,261,800		
非準備先残高	289,500		289,500		289,500		289,500		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	90.0%		90.0%		90.0%		90.0%		
乖離率	9.9%		9.9%		9.9%		9.9%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,076,200

7/13以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100

7/13以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	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	-	-0.070
ビッド	-	0.000
出来値	-	-0.060

7/11 時点のマナターベース(単位:億円) 3,993,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	7/10
長期国債	202	282	328
CP等	2.2	2.2	1.9
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	8.6
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	55
その他とも資産計	300	383	438
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	305
その他とも負債・純資産計	300	383	438

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%

7/11 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	68,950	+631	
有担	20,688	+1,804	
無担	48,262	-1,173	

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.000	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.050	-0.010	-	-	-	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.081	-0.074	-	-0.096	-0.100	-0.111	-0.122	-	-0.211	-0.230	-0.235

§ 7/13 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は▲0.08～▲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。

7/13 の予定(国内)

8:50 5月のマナターサーベイ(日銀)
13:30 5月の鉱工業生産・確報(経産省)

7/13 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
6月の財政収支
バージュック

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	▲12,100	3,013,000	+3,013,000	-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

*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
7/14 ~ 7/21	担保範囲内	180	180	0.890%	固定金利	- 1.00
7/8 ~ 7/14	担保範囲内	220	220	0.890%	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