

DAILY SIGNAL

平成28年7月13日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは225兆5,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.04%の出合から始まった。その後は▲0.06%～▲0.03%のレンジで取引され、一部▲0.02%まで取り上がる堅調な地合となった。後場に入ってもビッドの水準は変わらず、調整程度の出合が散見されて引けた。

(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	-	-	2,255,000	+2,255,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/13 のオペ結果
	7/13(水)		7/14(木)		7/15(金)		7/19(火)		
券	+600		▲900		▲2,000		+0		9:20
財政	▲14,100		▲5,500		▲11,000		▲27,000		ノオベ
過不足	▲13,500		▲6,400		▲13,000		▲27,000		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(7/15-)
国債買入						+7,500			(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入									+0.006%按分(13.2%) 4,308億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									+0.011%按分(59.8%) 2,003億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先									+0.029%按分(11.5%) 1,203億
CP等買入	▲100		▲400						11:50
社債等買入									国債補完供給(7/13-7/14)
ETF買入									▲0.600%全取 3,523億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノオベ
貸出									13:00
国債補完供給	+3,000	▲3,600	+3,600						ノオベ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲14,200		▲3,200		▲5,500		▲29,800		
当座預金残高	3,010,900		3,007,700		3,002,200		2,972,400		
準備預金残高	2,731,800								共通担保(本店)
積み終了先	2,260,600								共通担保(全店)
超過準備	2,260,600								国債買現先
非準備先残高	279,100								CP買現先
準備預金進捗率	100.0%								成長基盤強化
平均	93.3%		予想込増減 ▲3,200		予想込増減 ▲5,500		予想込増減 ▲21,800		被災地金融機関支援
乖離率	6.7%		当預見込 3,007,700		当預見込 3,002,200		当預見込 2,980,400		ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,076,200
7/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
7/14 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	-0.020	-0.100
レボG.C	-	-0.080
ビッド	-	0.000
出来値	-	-0.060

7/12 時点のマナタリーベース(単位:億円) 4,029,500

(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%

7/12 のコール市場残高(前日比)

	合計	7/14	前日比
有担	19,372	-1,316	
無担	52,074	+3,812	

*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	-0.070	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.044	0.000	0.000	0.000	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.077	-0.057	-	-0.093	-0.097	-0.110	-0.120	-	-0.207	-0.229	-0.235

§ 7/14 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は▲0.065%～▲0.03%で取引されよう。
共通担保オペは期落ち分8,000億円がロールオファーされると予想する。

7/14 の予定(国内)

8:50 前週の対外及び対内証券売買契約等の状況 (財務省)

7/14 の予定(海外)

米 6月の生産者物価
週間の新規失業保険申請件数
英 BOEの金融政策発表

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
◎ ノオベ	▲3,200	3,007,700	+3,007,700	-0.065	-0.060	-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