

DAILY SIGNAL

平成28年7月20日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは221兆円だった。
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、▲0.06~▲0.03%のレンジで推移した。
後場に入っても地合は変わらず、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,210,000	+2,210,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/20 のオペ結果
	7/20(水)		7/21(木)		7/22(金)		7/25(月)		
券	+200		▲1,100		▲1,000		+0		9:20
財政	▲19,700		+1,400		▲12,000		▲9,000		ノオベ
過不足	▲19,500		+300		▲13,000		▲9,000		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	ノオベ
国債買入	+9,000		+4,700						10:40
国庫短期証券買入			+35,100						社債等買入(7/26-)
国債買現先									▲0.304%按分(13.4%) 1,000億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)							▲2,700		国債補完供給(7/20-7/21)
CP買現先			▲200						▲0.500% 全取863億
CP等買入	▲500		+3,500						12:50
社債等買入									ノオベ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									ノオベ
被災地金融機関支援					▲1,100		+1,100		
貸出									
国債補完供給	+500		+900						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲11,100		+44,300		▲13,000		▲11,700		
当座預金残高	2,967,400		3,011,700		2,998,700		2,987,000		
準備預金残高	2,669,600								共通担保(本店) 0
積み終了先	2,187,200		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 7,090
超過準備	2,183,300								国債買現先 0
非準備先残高	297,800								CP買現先 0
準備預金進捗率	98.2%								成長基盤強化 68,139
平均	16.1%		予想込増減 +44,300		予想込増減 ▲13,000		予想込増減 ▲3,700		被災地金融機関支援 4,581
乖離率	82.0%		当預見込 3,011,700		当預見込 2,998,700		当預見込 2,995,000		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,137,000
7/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 39,300
7/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,500

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.020	-
レボ	-	-0.100
ビット	-	-0.085
出来値	-	0.000
	-	-0.075

7/19 時点のマナターベース(単位:億円) **3,983,100**

(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
7/15	621(1Y)	-0.3289%	-0.3587%
7/14	620(3M)	-0.2533%	-0.2962%
7/7	619(3M)	-0.3032%	-0.3234%

7/19 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	67,539	-6,457	-
	19,864	-209	-
	47,675	-6,248	-

*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	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.230	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.037	-0.010	-	0.013	0.010	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.068	-0.077	-	-0.087	-0.101	-0.111	-0.132	-	-0.193	-0.233	-0.235

§ 7/21 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。

7/21 の予定(国内)

13:30 5月の全産業活動指数(経産省)

7/21 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
欧 ECB理事会、ECB総裁の会見

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	+44,300	3,011,700	+3,011,700	-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
2016/7/19 ~ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

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
7/21 ~ 7/28	担保範囲内	180	180	0.890%	固定金利	- 1.00
7/14 ~ 7/21	担保範囲内	180	180	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