

DAILY SIGNAL

平成28年7月21日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは224兆1,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.03%の出合から始まり、
その後は▲0.04～▲0.02%のレンジで推移した。
一部▲0.06%での出合が見られたものの、堅調な地合いに変化はなかった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,241,000	+2,241,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/21 のオペ結果
	7/21(木)		7/22(金)		7/25(月)		7/26(火)		
券	▲1,000		▲1,800		+0		+0		9:20
財政	+500		▲11,000		▲9,000		▲5,000		ノーオペ
過不足	▲500		▲12,800		▲9,000		▲5,000		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(7/25-)
国債買入		+4,700				+11,400			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入		+35,100							+0.002%按分(58.2%) 3,753億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)					▲2,700	+4,800			▲0.004%按分(56.1%) 4,401億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先									+0.016%按分(3.1%) 2,003億
CP等買入	▲200	+3,500	▲200						(残存25年超)
社債等買入			▲100						+0.030%按分(96.9%)1,202億
ETF買入									11:50
J-REIT買入									国債補完供給(7/21-7/22)
被災地金融機関支援			▲1,100	+1,100					▲0.500% 全取 469億
貸出									12:50
国債補完供給	+900	▲500	+500						ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									共通担保(全店)(固定金利)
									(7/25-8/8)
									0% 全取 4,790億
当座預金増減	+43,000		▲12,600		+4,500		▲4,000		
当座預金残高	3,010,400		2,997,800		3,002,300		2,998,300		
準備預金残高	2,708,700		2,233,000						共通担保(本店)
積み終了先	2,230,000		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
超過準備	2,230,400								国債買現先
非準備預金残高	301,700								CP買現先
準備預金進捗率	98.7%								成長基盤強化
平均	19.4%		予想込増減 ▲12,600		予想込増減 +4,500		予想込増減 ▲4,000		被災地金融機関支援
乖離率	79.3%		当預見込 2,997,800		当預見込 3,002,300		当預見込 2,998,300		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,137,000
7/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 27,700
7/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,100

	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	-0.075
ビッド	-	-	0.000	-0.060
出来値	-	-	-	-

7/20 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,971,800**

(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
国債	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
7/21	622(3M)	-0.2505%	-0.2685%
7/15	621(1Y)	-0.3289%	-0.3587%
7/14	620(3M)	-0.2533%	-0.2962%

7/20 のコール市場残高(前日比)

	合計	71,811	+4,272
有担	20,089	+225	
無担	51,722	+4,047	

*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	-0.080	-	-	-	-0.038	-	-0.040	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-0.030	-	0.000	-	-	-	-
加重平均	-0.035	-0.020	-	-0.020	-0.034	-	-0.036	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.080	-0.078	-	-0.093	-0.103	-0.111	-0.138	-	-0.192	-0.233	-0.235

§ 7/22 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.04%～▲0.025%を中心に取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

7/22 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)

7/22 の予定(海外)

米 7月の製造業PMI速報
(財務省)

10:00 7月20日現在の営業毎旬報告(日銀)

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	▲12,600	2,997,800	+2,997,800	-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
2016/7/25 ~ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	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
2016/7/19 ~ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	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
2016/7/11 ~ 2016/7/25	8,000	2,690	2,690	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
2016/7/8 ~ 2016/10/18	15,000	50	50	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
2016/7/5 ~ 2016/10/14	15,000	60	60	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/7/4 ~ 2016/7/19	8,000	2,830	2,830	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
2016/7/1 ~ 2016/10/11	15,000	70	70	0.00%	固定金利	-	札割れ	7/21 ~ 7/28	担保範囲内	180	180	0.890%	固定金利	-	1.00
2016/6/28 ~ 2016/10/7	15,000	50	50	0.00%	固定金利	-	札割れ	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