

# DAILY SIGNAL

平成28年7月22日(金)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 7/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは223兆3,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%の落ちから始まり、  
その後は、▲0.04～▲0.02%のレンジで推移した。  
後場においては、調整程度の落ちが見られ、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	-	-	2,233,000	+2,233,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/22 のオペ結果
	7/22(金)		7/25(月)		7/26(火)		7/27(水)		
券									9:20
財政		▲1,800		▲400		+0		▲1,000	ノーオペ
過不足		▲11,000		▲8,600		▲5,000		▲2,000	10:10
金融調節		▲12,800		▲9,000		▲5,000		▲3,000	国庫短期証券買入(7/26-)
国債買入	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	▲0.012%按分(46.2%)15,001億
国債買入				+11,600					11:50
国庫短期証券買入						+15,000			国債補完供給(7/22-7/25)
国債買現先									▲0.500% 全取 123億
共通担保(本店)			▲2,700	+4,800					12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲300						ノーオペ
社債等買入	▲100		▲200			+1,000			
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援	▲1,100	+1,100							
貸出									
国債補完供給	+500	▲100	+100						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減		▲12,700		+4,300		+11,000		▲3,000	
当座預金残高		2,997,700		3,002,000		3,013,000		3,010,000	
準備預金残高		2,700,600							共通担保(本店)
積み終了先		2,231,600							共通担保(全店)
超過準備		2,229,600							国債買現先
非準備先残高		297,100							CP買現先
準備預金進捗率		99.2%							成長基盤強化
平均		29.0%	予想込増減	+4,300	予想込増減	+11,000	予想込増減	▲3,000	被災地金融機関支援
乖離率		70.2%	当預見込	3,002,000	当預見込	3,013,000	当預見込	3,010,000	ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,137,000  
7/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 16,300  
7/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 700

	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	-0.095
ビッド	-	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

7/21 時点のマナターベース(単位:億円) **4,015,800**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	7/20
長期国債	202	282	328
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	3.8	6.9	8.7
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	52
その他とも資産計	300	383	436
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	297
その他とも負債・純資産計	300	383	436

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%

7/21 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	71,278	-533	-
	20,004	-85	-
	51,274	-448	-

\*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.030	-0.010	-	-0.020	-0.025	-	0.000	-	-	-	-
東京レボレート	-0.079	-0.072	-	-0.094	-0.105	-0.115	-0.142	-	-0.195	-0.233	-0.235

## § 7/25 オファーのオペと市場動向予想

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

## 7/25 の予定(国内)

8:50 16年上期と6月の貿易統計(財務省)  
未定 7月の月例経済報告(内閣府)

## 7/25 の予定(海外)

なし

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	+4,300	3,002,000	+3,002,000	-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								

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 登録財務機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会