

DAILY SIGNAL

平成28年7月27日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは226兆2,000億円だった。
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。
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	-	-	2,262,000	+2,262,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/27 のオペ結果
	7/27(水)		7/28(木)		7/29(金)		8/1(月)		
券	▲600		▲1,200		▲1,000		+1,000		9:20 ノオペ 10:10 国債買入(7/29-) (残存5年超10年以下) ▲0.035%按分(95.2%) 4,306億 (残存10年超25年以下) ▲0.043%按分(65.3%) 2,002億 (残存25年超) ▲0.055%按分(52.8%) 1,203億 11:50 国債補完供給(7/27-7/28) ▲0.500% 全取 207億 12:50 ノオペ 13:00 ノオペ
財政	▲600		▲3,500		+24,500		▲15,000		
過不足	▲1,200		▲4,700		+23,500		▲14,000		
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		+12,700				+7,500			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲4,000		
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲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	+300	▲200	+200						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+11,200		▲4,700		+34,500		▲18,000		
当座預金残高	3,023,500		3,018,800		3,053,300		3,035,300		
準備預金残高	2,720,800		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) +8,000		
積み終了先	2,257,500		ノオペ		ノオペ		共通担保(本店) 0		
超過準備	2,257,500		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) 9,190		
非準備先残高	302,700		ノオペ		ノオペ		国債買現先 0		
準備預金進捗率	99.4%		ノオペ		ノオペ		CP買現先 0		
平均	38.7%		予想込増減 ▲4,700		予想込増減 +34,500		予想込増減 ▲10,000		
乖離率	60.7%		当預見込 3,018,800		当預見込 3,053,300		当預見込 3,043,300		
							成長基盤強化 68,139		
							被災地金融機関支援 4,581		
							ロンハート残高 0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,136,900
7/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 11,900
7/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.010	-0.100
レボ	-0.040	0.000
ビッド	-0.040	-0.100
出来値	-	-

7/26 時点のマナターベース(単位:億円) **4,021,200**

(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%

7/26 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
7/26	76,795	19,773	57,022
7/25	+4,365	-379	+4,744

*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	-0.050	-0.020	-	-0.020	-	-	-0.020	-	-	-	-
最高	0.001	-0.010	-	-0.003	-	-	0.000	-	-	-	-
加重平均	-0.028	-0.017	-	-0.014	-0.010	0.000	-0.013	-	-	-	-
東京レポレート	-0.085	-0.089	-	-0.108	-0.115	-0.126	-0.153	-	-0.206	-0.234	-0.235

§ 7/28 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。

7/28 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(29日まで)

7/28 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数

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
◎ ノオペ	▲4,700	3,018,800	+3,018,800	-0.080	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.070	-0.070
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

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	7/28 ~ 8/4	担保範囲内	130	130	0.870%	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	7/21 ~ 7/28	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