DAILY SIGNAL

平成28年7月29日(金)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 7/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは225兆8,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出合から始まり、
その後は、▲0.07～▲0.03%のレンジで推移した。
本日実施の日銀金融政策決定会合では、ETF買入れ額の増額（年間約3.3兆円から約6兆円へ）を決定した。

	即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
8:00	－	－	2,258,000	+2,258,000

（単位：億円）

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/29 のオペ結果
	7/29(金)		8/1(月)		8/2(火)		8/3(水)		
券		▲800		+1,000		+1,000		+1,000	9:20 ノーオペ
財政		+1,300		▲20,900		▲10,000		▲50,000	10:10 ノーオペ
過不足		+500		▲19,900		▲9,000		▲49,000	11:50
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		+8,400							国債補完供給(7/29-8/1)
国庫短期証券買入									▲0.500% 全取 375億
国債買現先									
共通担保(本店)									12:50 ノーオペ
共通担保(全店)			▲4,000	+5,100					13:00 ノーオペ
CP買現先									13:50
CP等買入	▲2,300	+3,500	▲100						国債補完供給(7/29-8/1)
社債等買入	▲200								▲0.500% 全取 97億
ETF買入									
J－REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+200	▲500	+500						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減		+9,600		▲18,400		▲9,000		▲49,000	
当座預金残高		3,027,900		3,009,500		3,000,500		2,951,500	
準備預金残高		2,713,700	共通担保オペ当社予想						共通担保(本店) 0
積み終了先		2,255,300	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 9,190
超過準備		2,255,300							国債買現先 0
非準預先残高		314,200							CP買現先 0
準備預金進捗率		99.6%							成長基盤強化 68,139
平均		51.6%	予想込増減	▲18,400	予想込増減	▲9,000	予想込増減	▲49,000	被災地金融機関支援 4,581
乖離率		48.0%	当預見込	3,009,500	当預見込	3,000,500	当預見込	2,951,500	ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,139,400
8/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,900
8/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オファー	-0.010	－	-0.100	-0.095
ビッド	-0.050	－	0.000	-0.080
出来値	－	－	－	－

7/28 時点のマネタリーベース(単位：億円) 4,029,200

(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
7/28	623(3M)	-0.2745%	-0.2933%
7/21	622(3M)	-0.2505%	-0.2685%
7/15	621(1Y)	-0.3289%	-0.3587%

7/28 のコール市場残高(前日比)

合計	82,437	+1,438
有担	19,293	-582
無担	63,144	+2,020

*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	-0.075	－	－	-0.030	－	－	－	－	－	－	－
最高	0.001	－	－	-0.020	－	－	－	－	－	－	－
加重平均	-0.046	-0.020	－	-0.025	0.000	－	－	－	－	－	－
東京レポ・レート	-0.088	-0.077	－	-0.108	-0.118	-0.141	-0.167	－	-0.215	-0.243	-0.249

§ 8/1 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は朝方▲0.05%～▲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。

8/1 の予定(国内)
未定 黒田日銀総裁記者会見要旨
臨時国会を招集（3日まで）
13:00 日銀当座預金増減要因と金融調節（7月実績）

8/1 の予定(海外)
米 ISM製造業指数（7月）
製造業PMI（7月、確報）

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	▲18,400	3,009,500	+3,009,500	-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

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2016/8/1 ～ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	0.00%	固定金利	－	札割れ
2016/7/25 ～ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	0.00%	固定金利	－	札割れ
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

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	按分レート	平均レート	按分率	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%	1.24
2012/6/1 ～ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2012/4/20 ～ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
7/28 ～ 8/4	担保範囲内	130	130	0.870%	固定金利	－	1.00
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