DAILY SIGNAL

平成29年6月26日(月)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 6/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは322兆5,000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まった。
その後、▲0.07～▲0.04%の水準で取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.08%での出合も見られた。
同加重平均金利は昨日対比▲0.002%の▲0.053%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
8:00	－	－	3,225,000	3,225,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想			
	6/26(月)		6/27(火)		6/28(水)		6/29(木)	
券	▲400		▲800		▲1,000		▲1,000	
財政	▲10,700		+2,400		▲1,000		+0	
過不足	▲11,100		+1,600		▲2,000		▲1,000	
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				+9,000		+5,500		
国庫短期証券買入				+7,500				
国債買現先								
国債売現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)	▲2,600	+1,300						
CP買現先								
CP等買入	▲400		▲200					
社債等買入		+1,500						
ETF買入				+700				
J－REIT買入								
被災地金融機関支援貸出								
国債補完供給	+300	▲200	+200					
米ドル供給用担保国債供給								
成長基盤強化支援貸出増加支援								
当座預金増減	▲11,200		+18,800		+3,500		▲1,000	
当座預金残高	3,604,800		3,623,600		3,627,100		3,626,100	
準備預金残高	3,223,500		共通担保オペ当社予想					
積み終了先	3,222,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ	
超過準備	3,222,400							
非準預先残高	381,300							
準備預金進捗率	99.7%							
平均	36.7%		予想込増減	+18,800	予想込増減	+3,500	予想込増減	▲1,000
乖離率	63.1%		当預見込	3,623,600	当預見込	3,627,100	当預見込	3,626,100

6/26 のオペ結果

9:20
ノーオペ
10:10
国債買入(6/28-)
(残存1年以下)
+0.051% 按分(27.0%) 1,002億
(残存5年超10年以下)
+0.000% 按分(99.5%) 4,503億
11:50
国債補完供給(6/26-6/27)
▲0.600% 全取 183億

12:50
ノーオペ
13:00
ノーオペ

共通担保(全店)	3,490
国債買現先	0
CP買現先	0
成長基盤強化	88,941
被災地金融機関支援	5,205
ロンバート残高	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,892,200
6/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 8,000
6/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オファー	−0.050	－	−0.100	−0.060
ビッド	−0.070	－	0.000	−0.045
出来値	－	－	－	－

6/23 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,663,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)

	15年末実績	16年末実績	6/20
長期国債	282	361	389
CP等	2.2	2.3	2.5
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	6.9	11.1	14.2
J－REIT	0.27	0.36	0.40
貸出支援基金	31	41	47
国庫短期証券	43	50	34
その他とも資産計	383	476	498
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	361
その他とも負債・純資産計	383	476	498

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
6/22	691 (3M)	−0.0962%	−0.1002%
6/15	690 (1Y)	−0.1128%	−0.1158%
6/14	689 (3M)	−0.0991%	−0.1035%

6/23 のコール市場残高(前日比)

合計	99,460	+330
有担	23,108	+10
無担	76,352	+320

*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	−0.053	－	－	−0.045	－	－	0.060	－	－	－	－
東京レポ・レート	−0.061	−0.052	－	−0.085	−0.084	−0.084	−0.088	－	−0.096	−0.130	−0.161

§ 6/27 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.08～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想。

6/27 の予定(国内)
8:50 1～3月の資金循環速報(日銀)

6/27 の予定(海外)
米 4月のS&Pコアロジックcs住宅価格指数
6月の消費者信頼感指数
ミネアポリス連銀総裁の講演

翌営業日の即日オペ予想				
即日オペ金額		当預増減	当預残高	所要対比
◎	ノーオペ	+18,800	3,623,600	+3,623,600

翌営業日の出合いレンジ予想								
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
−0.080	−0.050	−0.050	−0.040	−0.020	−0.010	−0.010	−0.010	−0.010
～	～	～	～	～	～	～	～	～
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
2017/6/26 ～ 2017/7/10	8,000	1,310	1,310	0.00%	固定金利	－	札割れ
2017/6/19 ～ 2017/7/3	8,000	1,790	1,790	0.00%	固定金利	－	札割れ
2017/6/12 ～ 2017/6/26	8,000	2,580	2,580	0.00%	固定金利	－	札割れ
2017/6/12 ～ 2017/9/19	5,000	170	170	0.00%	固定金利	－	札割れ
2017/6/5 ～ 2017/6/19	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	－	札割れ
2017/5/29 ～ 2017/6/12	8,000	2,680	2,680	0.00%	固定金利	－	札割れ
2017/5/22 ～ 2017/6/5	8,000	1,840	1,840	0.00%	固定金利	－	札割れ
2017/5/15 ～ 2017/5/29	8,000	2,601	2,601	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
* 2017/5/24 ～ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	－	札割れ
* 2016/10/20 ～ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	－	札割れ
* 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

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
6/22 ～ 6/29	担保範囲内	0	0	1.640%	固定金利	0.0%	応札なし
6/15 ～ 6/22	担保範囲内	2	2	1.640%	固定金利	0.0%	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