

DAILY SIGNAL

平成29年7月3日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは322兆円だった。
7月初営業日となる本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まった。
その後は、▲0.07～▲0.04%のレンジで出合が見られた。
四半期末を通過し、先週末に資金調達を控えていた金融機関の調達が見られ、
同加重平均金利は先週末対比+0.009%の▲0.060%に上昇した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,220,000	3,220,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/3 のオペ結果
	7/3(月)		7/4(火)		7/5(水)		7/6(木)		
券	+500		+0		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲3,800		▲26,200		+2,000		▲22,000		10:10 国債買入(7/5-)
過不足	▲3,300		▲26,200		+2,000		▲22,000		(残存1年超3年以下)
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	▲0.014% 按分(84.1%) 2,801億
国債買入				+5,100		+8,800			(残存3年超5年以下)
国庫短期証券買入				+7,500					▲0.002% 按分(90.9%) 3,005億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
国債売現先									+0.001% 按分(33.4%) 2,011億
共通担保(本店)									(残存25年起)
共通担保(全店)	▲1,800	+1,600							+0.001% 按分(80.4%) 1,001億
CP買現先				▲400					11:50 国債補完供給(7/3-7/4)
CP等買入	▲100								▲0.600% 全取 180億
社債等買入									12:50 ノーオペ
ETF買入									13:00 ノーオペ
J-REIT買入									13:50 ノーオペ
被災地金融機関支援									国債補完供給(7/3-7/4)
貸出				+200					▲0.600% 全取 1億
国債補完供給	+2,800	▲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	▲1,000		▲13,800		+10,800		▲22,000		
当座預金残高	3,628,500		3,614,700		3,625,500		3,603,500		
準備預金残高	3,230,600		3,230,500		3,230,500		3,230,500		
積み終了先	3,230,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 3,290
超過準備	3,230,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先 0
非準備預金残高	397,900		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化 88,941
平均	60.0%		予想込増減 ▲13,800		予想込増減 +10,800		予想込増減 ▲22,000		被災地金融機関支援 5,205
乖離率	39.9%		当預見込 3,614,700		当預見込 3,625,500		当預見込 3,603,500		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,893.900
7/4 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 2,000
7/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.055	-0.100
レボ	-0.065	-0.045
ビッド	-0.065	0.000
出来値	-	-

6/30 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,680,400

(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
6/29	692 (3M)	-0.0942%	-0.0982%
6/22	691 (3M)	-0.0962%	-0.1002%
6/15	690 (1Y)	-0.1128%	-0.1158%

6/30 のコール市場残高(前日比)		
合計	78,649	-13,095
有担	18,405	-1,209
無担	60,244	-11,886

*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	-0.086	-	-	-0.047	-0.060	-	-0.030	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.040	0.001	-	-0.013	-	-	-	-
加重平均	-0.060	0.001	-	-0.044	-0.040	-0.055	-0.022	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.062	-0.052	-	-0.063	-0.067	-0.069	-0.075	-	-0.093	-0.121	-0.150

§ 7/4 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。

7/4 の予定(国内)

8:50 6月調査の短観全容・企業の物価見通し(日銀) 米 休日(独立記念日)
10:00 6月30日現在の毎営業旬報告(日銀) ユーロ圏 5月の生産者物価
14:00 5月の基調的なインフレ率を補足するための指標(日銀)

7/4 の予定(海外)

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	▲13,800	3,614,700	+3,614,700	-0.080	-0.060	-0.060	-0.050	-0.040	-0.030	-0.010	-0.010
					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	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2017/7/3 ~ 2017/7/18	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	-	札割れ
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 ~ 2017/6/19	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

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
6/29 ~ 7/7	担保範囲内	10	10	1.630%	固定金利	0.0%	1.00
6/22 ~ 6/29	担保範囲内	0	0	1.640%	固定金利	0.0%	応札なし

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