

DAILY SIGNAL

平成29年7月5日(水)

上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/5 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは323兆7,000億円だった。
 本日の無担保コールON物は▲0.045%の出合からスタート。
 その後は、▲0.06～▲0.035%のレンジで出合が見られた。
 同加重平均金利は▲0.054%と昨日とほぼ変わらずの水準であった。

	即日オペ種類	オファー額	準備預金見込	所要対比
8:00	-	-	3,237,000	3,237,000

(単位:億円)

	日銀速報 7/5(水)		日銀予想 7/6(木)		当社需給予想 7/7(金) 7/10(月)				7/5 のオペ結果 9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(7/7-) (残存1年超3年以下) ▲0.002% 按分(90.2%) 2.804億 (残存3年超5年以下) +0.002% 按分(67.9%) 3.004億 (残存5年超10年以下) +0.002% 按分(5.8%) 4.506億 10:40 米ドル資金供給(7/7-7/13) 貸付利率 1.650% 0百万米ドル 11:50 国債補完供給(7/5-7/6) ▲0.600% 全取 242億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
	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	
券	+100		▲300		▲1,000		+1,000		
財政	+3,000		▲24,900		+3,000		▲31,000		
過不足	+3,100		▲25,200		+2,000		▲30,000		
金融調節									
国債買入		+8,900				+10,300			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,300		
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲200			+3,500			
社債等買入									
ETF買入		+200	+500						
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+600	▲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	+12,200		▲24,700		+15,800		▲31,300		
当座預金残高	3,625,500		3,600,800		3,616,600		3,585,300		
準備預金残高	3,237,700								
積み終了先	3,237,500		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		
超過準備	3,237,500							共通担保(全店) 3,290	
非準備先残高	387,800							国債買現先 0	
準備預金進捗率	99.9%							CP買現先 0	
平均	66.7%		予想込増減 ▲24,700		予想込増減 +15,800		予想込増減 ▲23,300	成長基盤強化 88,941	
乖離率	33.2%		当預見込 3,600,800		当預見込 3,616,600		当預見込 3,593,300	被災地金融機関支援 5,205	
								ロンバード残高 0	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,893,900
 7/6 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,500
 7/6 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	レポG.C
オファー	-0.045	-	-0.100	-0.090
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.070
出来値	-	-	-	-

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	6/30
長期国債	282	361	392
CP等	2.2	2.3	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	14.4
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	35
その他とも資産計	383	476	502
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	363
その他とも負債・純資産計	383	476	502

T-Billの入札結果(直近3回)			
入札日	回数	最高利回	平均利回
7/5	693 (6M)	-0.1000%	-0.1019%
6/29	692 (3M)	-0.0942%	-0.0982%
6/22	691 (3M)	-0.0962%	-0.1002%

7/4 のコール市場残高(前日比)			
合計	有担	無担	
83,830	20,136	63,694	+849
			-730
			+1,579

7/4 時点のマナターベース(単位:億円) **4,663,700**

*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	-	-	-0.050	-0.030	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-	-	-0.044	-0.024	0.000	-	-	-	-	-
東京レポ・レート	-0.063	-0.063	-	-0.068	-0.071	-0.071	-0.077	-	-0.096	-0.121	-0.151

§ 7/6 オファーのオペと市場動向予想

7/6 の予定(国内)

7/6 の予定(海外)

足許は▲0.08～+0.001%のレンジで取引されよう。
 共通担保オペは期落ち分がロールオペとされよう。

米 6月のADP雇用統計
 6月のISM非製造業指数
 ユーロ圏 ECB理事会議事要旨

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	▲24,700	3,600,800	+3,600,800	-0.080	-0.060	-0.060	-0.050	-0.040	-0.030	-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

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
2017/7/3 ~ 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

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
7/7 ~ 7/13	担保範囲内	0	0	1.650%	固定金利	0.0%	応札なし
6/29 ~ 7/7	担保範囲内	10	10	1.630%	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