

# DAILY SIGNAL

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

## § 7/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは324兆3,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は▲0.055%の出合から始まり、その後は▲0.06~▲0.03%のレンジで取引された。後場に入っても水準は変わらず、調整程度の出合が見られて引けた。  
10時10分、日銀は固定利回り方式による国債買入オペ(通称:指値オペ)をオファーするも応札はなかった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	3,243,000	3,243,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/7 のオペ結果
	7/7(金)		7/10(月)		7/11(火)		7/12(水)		
券	▲300		+900		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	+8,700		▲30,800		+3,000		▲14,000		10:10 国庫短期証券買入(7/11-) ▲0.007% 按分(96.0%) 15,002億
過不足	+8,400		▲29,900		+3,000		▲14,000		国債買入(固定利回り方式) (7/11-) (残存5年超10年以下) 固定利回り較差0.015% 応札 0億
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(7/11-) (残存5年超10年以下) ▲0.009% 按分(77.5%) 5,010億 (残存10年超25年以下) ▲0.028% 按分(33.0%) 2,000億 (残存25年超) +0.021% 按分(9.9%) 1,002億
国債買入		+10,500				+8,000			11:50 国債補完供給(7/7-7/10) ▲0.600% 全取 759億
国庫短期証券買入						+15,000			12:50 ノーオペ
国債買現先									13:50 国債補完供給(7/7-7/10) ▲0.600% 全取 15億
国債売現先									
共通担保(本店)			▲1,300	+1,300					共通担保(全店) 3,290
共通担保(全店)									国債買現先 0
CP買現先									CP買現先 0
CP等買入	▲200	+3,500	▲400						成長基盤強化 88,941
社債等買入									被災地金融機関支援 5,205
ETF買入		+100							ロンハート残高 0
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+900	▲800	+800						
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	+22,400		▲29,500		+26,000		▲14,000		
当座預金残高	3,625,900		3,596,400		3,622,400		3,608,400		
準備預金残高	3,244,400		3,244,300		3,244,300		3,244,300		
積み終了先	3,244,300		3,244,300		3,244,300		3,244,300		
超過準備	3,244,300		3,244,300		3,244,300		3,244,300		
非準備預金残高	381,500		381,500		381,500		381,500		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	80.0%		80.0%		80.0%		80.0%		
乖離率	19.9%		19.9%		19.9%		19.9%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,903.700  
7/10 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 1,100  
7/10 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	-0.040	-	-0.100	-0.105
ビッド	-0.065	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

7/6 時点のマナタリーベース(単位:億円) 4,654,200

(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	回号	最高利回	平均利回
7/6	694 (3M)	-0.0912%	-0.0955%
7/5	693 (6M)	-0.1000%	-0.1019%
6/29	692 (3M)	-0.0942%	-0.0982%

7/6 のコール市場残高(前日比)			
合計	87,752	+553	
有担	20,881	-689	
無担	66,871	+1,242	

\*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	-0.085	-	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.015	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.050	-	-	-0.037	-0.040	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.077	-0.084	-	-0.085	-0.085	-0.087	-0.089	-	-0.098	-0.123	-0.151

## § 7/10 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.085~+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。

## 7/10 の予定(国内)

日銀支店長会議  
8:50 5月の機械受注(内閣府)  
未定 地域経済報告(日銀)

## 7/10 の予定(海外)

米 FRBの6月の労働市場情勢指数

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
◎	ノーオペ	▲29,500	3,596,400	+3,596,400	-0.085	-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)

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
2017/7/10 ~ 2017/7/24	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	札割れ
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 ~ 2017/9/19	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

### \*当日物

### 共通担保資金供給(本店)

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

### 米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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