

DAILY SIGNAL

平成29年7月12日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは322兆4,000億円だった。本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まった。その後は、主に▲0.055～▲0.03%の水準で出合が見られた。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同加重平均金利は前日対比+0.004%の▲0.044%であった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,224,000	3,224,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/12 のオペ結果
	7/12(水)		7/13(木)		7/14(金)		7/18(火)		
券	+200		▲800		▲1,000		+1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲10,200		▲24,200		+4,000		▲31,000		10:10 国債買入(7/14-)
過不足	▲10,000		▲25,000		+3,000		▲30,000		(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	(残存3年超5年以下)
国債買入						+11,100			▲0.006% 按分(17.6%) 2,803億
国庫短期証券買入									(残存5年超10年以下)
国債買現先									▲0.004% 按分(78.2%) 3,303億
国債売現先									(残存5年超10年以下)
共通担保(本店)									▲0.002% 按分(73.8%) 5,006億
共通担保(全店)							▲1,600		10:40 CP等買入(7/18-)
CP買現先									▲0.001% 按分(58.3%) 3,489億
CP等買入	▲200		▲400						11:50 国債補完供給(7/12-7/13)
社債等買入	▲100			+100					▲1.500% 全取 1,077億
ETF買入									12:50 ノーオペ
J-REIT買入									13:00 ノーオペ
被災地金融機関支援									13:50 国債補完供給(7/12-7/13)
貸出									▲0.500% 全取 50億
国債補完供給	+1,800	▲1,100	+1,100						
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	▲9,600		▲24,200		+14,100		▲28,100		
当座預金残高	3,602,400		3,578,200		3,592,300		3,564,200		
準備預金残高	3,220,700		3,220,500		3,220,500		3,220,500		
積み終了先	3,220,500		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 3,280
超過準備	3,220,500		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		国債買現先 0
非準備先残高	381,700		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		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	90.0%		90.0%		90.0%		90.0%		被災地金融機関支援 5,205
乖離率	9.9%		9.9%		9.9%		9.9%		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,903,700
7/13以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 400
7/13以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	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
ビット	-0.060	0.000
出来値	-	-

7/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,661,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	7/10
長期国債	282	361	395
CP等	2.2	2.3	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	14.5
J-REIT	0.27	0.36	0.41
貸出支援基金	31	41	47
国庫短期証券	43	50	33
その他とも資産計	383	476	503
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	359
その他とも負債・純資産計	383	476	503

T-Billの入札結果(直近3回)

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

7/11のコール市場残高(前日比)

	合計	平均レート
有担	19,518	-539
無担	70,905	-199

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.044	-	-	-0.040	-	-	-0.009	-0.045	-	-	-
東京レボ・レート	-0.086	-0.082	-	-0.093	-0.091	-0.092	-0.094	-	-0.100	-0.121	-0.151

§ 7/13 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.07～+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ファーされると予想。

7/13の予定(国内)

特になし

7/13の予定(海外)

米 FRB議長の議会証言(米上院)
ソコ連銀の講演
ブレイトンFRB理事の講演

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	▲24,200	3,578,200	+3,578,200	-0.070	-0.045	-0.045	-0.040	-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)

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
2017/7/10 ~ 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

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
7/13 ~ 7/20	担保範囲内	1	1	1.650%	固定金利	0.0%	1.00
7/7 ~ 7/13	担保範囲内	0	0	1.650%	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