

DAILY SIGNAL

平成29年7月18日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは317兆1,000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.05%の割合から始まった。
その後は、主に▲0.07~▲0.045%の水準で出合が見られた。
新積期に入り、同加重平均金利は先週末対比0.013%低下し、▲0.055%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,171,000	3,171,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/18 のオペ結果
	7/18(火)		7/19(水)		7/20(木)		7/21(金)		
券	+500		+600		▲1,000		▲1,000		9:20 ノオペ
財政	▲28,000		▲100		▲16,000		▲1,000		10:10 ノオペ
過不足	▲27,500		+500		▲17,000		▲2,000		10:40 ノオペ
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	11:50 ノオペ
国債買入				+9,300		+6,300			12:50 ノオペ
国庫短期証券買入				+7,500					13:00 ノオペ
国債買現先									13:00 ノオペ
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲1,600	+1,600							
CP買現先									
CP等買入	▲500	+3,500	▲300						
社債等買入			▲100						
ETF買入		+300		+400					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+700	▲100	+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	▲23,600		+17,400		▲10,700		▲3,100		
当座預金残高	3,567,300		3,584,700		3,574,000		3,570,900		
準備預金残高	3,165,000		3,122,400		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) 3,281
積み終了先	3,073,100		ノオペ		ノオペ		ノオペ		国債買現先 0
超過準備	402,300		ノオペ		ノオペ		ノオペ		CP買現先 0
非準備先残高	97.6%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		成長基盤強化 88,941
準備預金進捗率	9.7%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		被災地金融機関支援 5,205
平均	87.9%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		ロンハート残高 0
乖離率	87.9%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,999.300
7/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 72.200
7/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,600

	T/N	ユーロ円	T+2	レボG.C
無担	-0.040	-	-0.100	-0.100
CP現先	-0.055	-	0.000	-0.085
出値	-	-	-	-

7/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,642,100

(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	回号	最高利回	平均利回
7/18	696 (1Y)	-0.1138%	-0.1158%
7/13	695 (3M)	-0.1033%	-0.1082%
7/6	694 (3M)	-0.0912%	-0.0955%

7/14 のコール市場残高(前日比)

	合計	85,931	+1,940
有担	19,323	+209	
無担	66,608	+1,731	

*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	-	-	-	-0.040	-0.033	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.010	0.000	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-	-	0.000	-0.026	-0.022	-	-	-0.040	-	-
東京レボ・レート	-0.087	-0.082	-	-0.093	-0.096	-0.097	-0.101	-	-0.109	-0.122	-0.151

§ 7/19 オファタ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。
共通担保オペはノオペを予想。

7/19 の予定(国内)

日銀政策決定会合(20日まで)
7月の月例経済報告(内閣府)

7/19 の予定(海外)

米国 6月の住宅着工件数
週間のMBAローン申請指数

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオペ	+17,400	3,584,700	+3,584,700	-0.085	-0.050	-0.050	-0.045	-0.045	-0.040	-0.030	-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	按分レド	*当日物		
					平均レド	按分率	倍率
2017/7/18 ~ 2017/7/31	8,000	1,591	1,591	0.00%	固定金利	-	札割れ
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
2017/6/5 ~ 2017/6/19	8,000	1,950	1,950	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	按分レド	平均レド	按分率	倍率
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

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