

DAILY SIGNAL

§ 7/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは317兆9,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.055%の出合から始まった。
その後は▲0.075～▲0.045%のレンジで取引された。
後場では▲0.08%で調整程度の出合いが見られ、引けた。

平成29年7月24日(月)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,179,000	3,179,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/24 のオペ結果
	7/24(月)		7/25(火)		7/26(水)		7/27(木)		9:20 ノーオペ
券	▲300		▲200		+0		▲1,000		10:10 国債買入(7/26-)
財政	▲1,600		+3,400		+0		▲4,000		(残存1年超3年以下)
過不足	▲1,900		+3,200		+0		▲5,000		+0.003% 按分(47%) 2,802億
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	(残存3年超5年以下)
国債買入						+10,800			▲0.003% 按分(92.8%) 3,304億
国庫短期証券買入				+15,000					(残存5年超10年以下)
国債買現先									+0.000% 按分(48.8%) 4,708億
国債売現先									11:50
共通担保(本店)									国債補完供給(7/24-7/25)
共通担保(全店)	▲1,300	+1,300							▲0.600% 全取 45億
CP買現先			▲200						12:50
CP等買入	▲200		▲600						ノーオペ
社債等買入								+1,500	13:00
ETF買入		+700							ノーオペ
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給									
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	▲1,400		+17,400		+10,800		▲3,500		
当座預金残高	3,573,300		3,590,700		3,601,500		3,598,000		
準備預金残高	3,170,400		3,170,400		3,170,400		3,170,400		
積み終了先	3,168,200		3,168,200		3,168,200		3,168,200		共通担保(全店) 3,292
超過準備	3,168,200		3,168,200		3,168,200		3,168,200		国債買現先 0
非準備先残高	402,900		402,900		402,900		402,900		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		成長基盤強化 88,941
平均	29.0%		29.0%		29.0%		29.0%		被災地金融機関支援 5,205
乖離率	70.6%		70.6%		70.6%		70.6%		ロンハート残高 0
共通担保オペ当社予想									
ノーオペ									
ノーオペ									
ノーオペ									
予想込増減									
当預見込									

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,999,300
7/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 10,900
7/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	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	-0.095
ビッド	-0.070	-	0.000	-0.080
出来値	-	-	-	-

7/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,625,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	7/20
長期国債	282	361	396
CP等	2.2	2.3	2.3
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	32
その他とも資産計	383	476	503
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	358
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
7/19	697 (3M)	-0.1082%	-0.1106%
7/18	696 (1Y)	-0.1138%	-0.1158%
7/13	695 (3M)	-0.1033%	-0.1082%

7/21 のコール市場残高(前日比)

合計	86,234	-749
有担	20,614	-324
無担	65,620	-425

*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	-	-	-0.043	-0.045	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.030	-0.035	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.058	-	-	-0.039	-0.040	0.000	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.085	-0.088	-	-0.105	-0.100	-0.100	-0.102	-	-0.110	-0.124	-0.151

§ 7/25 オファタ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。

7/25 の予定(国内)

8:50 6月15～16日の日銀金融政策決定会合の
議事要旨(日銀)

7/25 の予定(海外)

米 FOMC(26日まで)
7月の消費者信頼感指数

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	+17,400	3,590,700	+3,590,700	-0.080	-0.050	-0.050	-0.045	-0.045	-0.040	-0.030	-0.010	-0.010
				～	～	～	～	～	～	～	～	～
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.080	0.100

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2017/7/24 ～ 2017/8/7	8,000	1,311	1,311	0.00%	固定金利	-	札割れ
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
2017/6/12 ～ 2017/9/19	5,000	170	170	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	按分レト	平均レト	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	按分レト	平均レト	按分率	倍率
7/20 ～ 7/27	担保範囲内	0	0	1.650%	固定金利	0.0%	応れなし
7/13 ～ 7/20	担保範囲内	1	1	1.650%	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