

DAILY SIGNAL

平成29年7月26日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは319兆5,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まった。
その後は▲0.075～▲0.05%のレンジで推移した。
本日は一部で試取りで+0.001%の出合が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	3,195,000	3,195,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/26 のオペ結果
	7/26(水)		7/27(木)		7/28(金)		7/31(月)		
券	▲700		▲1,400		▲1,000		▲1,000		9:20
財政	+1,500		▲7,300		+0		+31,000		ノオベ
過不足	+800		▲8,700		▲1,000		+30,000		10:10
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(7/28-)
国債買入		+10,900							(残存1年以下)
国庫短期証券買入									+0.001% 按分(76.9%) 1,006億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
国債売現先									+0.007% 按分(63.9%) 2,011億
共通担保(本店)									(残存25年超)
共通担保(全店)							▲1,800		+0.004% 按分(72%) 1,001億
CP買現先									10:40
CP等買入	▲200		▲100						CP等買入(7/31-)
社債等買入	▲300		▲100	+1,500					▲0.002% 按分(52.2%) 3,492億
ETF買入				+700					11:50
J-REIT買入									国債補完供給(7/26-7/27)
被災地金融機関支援									▲0.600% 全取 172億
貸出									12:50
国債補完供給	+600	▲200	+200						ノオベ
米ドル供給用担保国債供給									13:00
成長基盤強化支援									ノオベ
貸出増加支援									
当座預金増減	+11,600		▲6,500		▲1,000		+31,700		
当座預金残高	3,601,200		3,594,700		3,593,700		3,625,400		
準備預金残高	3,190,600		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 3,292
積み終了先	3,190,200		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0
超過準備	3,190,200		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0
非準備先残高	410,600		ノオベ		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化 88,941
準備預金進捗率	99.7%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		被災地金融機関支援 5,205
平均	35.5%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		ロンハート残高 0
乖離率	64.2%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,999,500
7/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 9,600
7/27 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
レボ	-0.070	0.000
ビッド	-	-0.075
出来値	-	-

7/25 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,640,700**

(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	回数	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%

7/25 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	88,179	+2,211	
有担	20,455	-85	
無担	67,724	+2,296	

*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	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.060	-	-	-0.028	-0.045	-	0.000	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.089	-0.089	-	-0.101	-0.100	-0.100	-0.102	-	-0.110	-0.124	-0.150

§ 7/27 オファ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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

7/27 の予定(国内)

特になし

7/27 の予定(海外)

米 6月耐久財受注
6月財の貿易収支
週間の新規失業保険申請件数

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
◎ ノオベ	▲6,500	3,594,700	+3,594,700	-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

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