

DAILY SIGNAL

平成28年7月11日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 7/11 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは222兆5,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.045%の出合から始まり、
その後は▲0.075%～▲0.04%のレンジで推移した。後場に入っても
地合に変化は見られず、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,225,000	+2,225,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				7/11 のオペ結果
	7/11(月)		7/12(火)		7/13(水)		7/14(木)		
券	+1,100		+500		+0		▲1,000		9:20
財政	▲59,600		▲6,600		▲17,000		▲8,000		ノーオペ
過不足	▲58,500		▲6,100		▲17,000		▲9,000		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	ノーオペ
国債買入				+11,900					11:50
国庫短期証券買入				+30,000					国債補完供給(7/11-7/12)
国債買現先									▲0.600%全取 91億
共通担保(本店)	▲4,100	+2,700							12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先			▲600	+3,500					13:00
CP等買入	▲600		▲100						ノーオペ
社債等買入									13:50
ETF買入		+100							国債補完供給(7/11-7/12)
J-REIT買入									▲0.600%全取 83億
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲200	+200						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲60,400		+38,800		▲17,000		▲9,000		
当座預金残高	2,988,700		3,027,500		3,010,500		3,001,500		
準備預金残高	2,709,900		2,233,500		2,233,500		2,233,500		共通担保(本店)
積み終了先	2,233,500		2,233,500		2,233,500		2,233,500		共通担保(全店)
超過準備	2,233,500		2,233,500		2,233,500		2,233,500		国債買現先
非準備預金残高	278,800		278,800		278,800		278,800		CP買現先
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化
平均	86.7%		86.7%		86.7%		86.7%		被災地金融機関支援
乖離率	13.2%		13.2%		13.2%		13.2%		ロンバート残高
			予想込増減	+38,800	予想込増減	▲17,000	予想込増減	▲9,000	
			当預見込	3,027,500	当預見込	3,010,500	当預見込	3,001,500	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,076,200

7/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200

7/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.030	-	-0.100	-0.080
ビッド	-	-	0.000	-0.070
出来値	-	-	-	-

7/8 時点のマナターベース(単位:億円) 4,055,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	6/30
長期国債	202	282	324
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	8.5
J-REIT	0.18	0.27	0.32
貸出支援基金	25	31	33
国庫短期証券	49	43	53
その他とも資産計	300	383	433
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	303
その他とも負債・純資産計	300	383	433

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
7/7	619(3M)	-0.3032%	-0.3234%
7/6	618(6M)	-0.3722%	-0.3939%
6/30	617(3M)	-0.2905%	-0.2957%

7/8 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	68,319	+1,296	
	18,884	-507	
	49,435	+1,803	

*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	0.000	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	-	-	-0.020	0.000	0.080	-0.040	-	-	-	-
東京レボレート	-0.080	-0.075	-	-0.098	-0.100	-0.112	-0.121	-	-2.11	-0.231	-0.235

§ 7/12 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は▲0.08～▲0.03%で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

7/12 の予定(国内)

8:50 6月の企業物価指数(日銀)
10:00 7月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

7/12 の予定(海外)

米 セントリス連銀総裁の講演

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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	+38,800	3,027,500	+3,027,500	-0.080	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.070	-0.070
				0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000

共通担保資金供給(全店)					*当日物					共通担保資金供給(本店)					*当日物				
期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/7/11 ~ 2016/7/25	8,000	2,690	2,690	0.00%	固定金利	-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ				
2016/7/8 ~ 2016/10/18	15,000	50	50	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24				
2016/7/5 ~ 2016/10/14	15,000	60	60	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70				
2016/7/4 ~ 2016/7/19	8,000	2,830	2,830	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46				
2016/7/1 ~ 2016/10/11	15,000	70	70	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/6/28 ~ 2016/10/7	15,000	50	50	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/6/27 ~ 2016/7/11	8,000	4,130	4,130	0.00%	固定金利	-	札割れ	7/8 ~ 7/14	担保範囲内	220	220	0.890%	固定金利	-	1.00				
2016/6/20 ~ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	0.00%	固定金利	-	札割れ	6/30 ~ 7/8	担保範囲内	1,475	1,475	0.870%	固定金利	-	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