

# DAILY SIGNAL

平成29年6月30日(金)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 6/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは322兆円だった。  
月末初物となる本日の無担保コールON物は▲0.08%の出合から始まった。  
その後は、▲0.085～▲0.05%のレンジで出合が見られた。  
一部四半期末越えの資金調達を控える金融機関が見られ、  
同加重平均金利は昨日対比▲0.016%の▲0.069%と低下した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,220,000	3,220,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/30 のオペ結果
	6/30(金)		7/3(月)		7/4(火)		7/5(水)		
券	▲700		+600		+1,000		+0		9:20 ノオベ 10:10 国庫短期証券買入(7/4-) ▲0.002% 按分(45.5%) 7,502億 国債買入(7/4-) (残存5年超10年以下) +0.014% 按分(4.0%) 4,512億 (物価連動債) ▲0.170円 按分(95.5%) 251億 11:50 国債補完供給(6/30-7/3) ▲0.600% 全取 2,772億  12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲200		▲4,900		▲41,000		+2,000		
過不足	▲900		▲4,300		▲40,000		+2,000		
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		+9,100				+4,800			
国庫短期証券買入						+7,500			
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)			▲1,800	+1,600					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲5,000	+3,500	▲100						
社債等買入	▲100								
ETF買入		+500							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+100	▲2,800	+2,800						
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	+4,400		▲1,800		▲27,700		+2,000		
当座預金残高	3,629,500		3,627,700		3,600,000		3,602,000		
準備預金残高	3,196,000								
積み終了先	3,195,900								
超過準備	3,195,300								
非準備預金残高	433,500								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	56.7%		予想込増減 ▲1,800		予想込増減 ▲27,700		予想込増減 +2,000		
乖離率	43.2%		当預見込 3,627,700		当預見込 3,600,000		当預見込 3,602,000		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,893,900  
7/3以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 2,100  
7/3以降の残り積み立て額(残り所要)平均) 200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.050	-	-0.100	-0.060
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.050
出来値	-	-	-	-

6/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,675,300**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	6/20
長期国債	282	361	389
CP等	2.2	2.3	2.5
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	6.9	11.1	14.2
J-REIT	0.27	0.36	0.40
貸出支援基金	31	41	47
国庫短期証券	43	50	34
その他とも資産計	383	476	498
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	361
その他とも負債・純資産計	383	476	498

## T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
6/29	692 (3M)	-0.0942%	-0.0982%
6/22	691 (3M)	-0.0962%	-0.1002%
6/15	690 (1Y)	-0.1128%	-0.1158%

## 6/29 のコール市場残高(前日比)

	合計	平均レート
有担	91,744	+556
無担	19,614	-421
無担	72,130	+977

\*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	-0.086	-	-	-0.050	-0.045	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-0.035	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.069	0.000	-	-0.039	-0.044	-	-	-0.010	-0.010	-	-
東京レボ・レート	-0.112	-0.054	-	-0.070	-0.072	-0.074	-0.079	-	-0.098	-0.124	-0.155

## § 7/3 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。  
共通担保オペはノオベを予想。

## 7/3 の予定(国内)

8:50 6月調査の短観概要(日銀)

## 7/3 の予定(海外)

米 6月の製造業PMI確報

6月のISM製造業指数

ユーロ圏 6月の製造業PMI確報

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	▲1,800	3,627,700	+3,627,700	-0.080	-0.050	-0.050	-0.040	-0.030	-0.020	-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
2017/7/3 ~ 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 ~ 2017/6/19	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
2017/5/22 ~ 2017/6/5	8,000	1,840	1,840	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

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