

DAILY SIGNAL

平成28年5月2日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは208兆3,000億円。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.07%の出合いから始まり、
その後は▲0.065～▲0.04%で取引された。後場に入ってから、
ビッドが薄くなり、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,083,000	+2,083,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/2 のオペ結果
	5/2(月)		5/6(金)		5/9(月)		5/10(火)		
券	▲100		+2,500		+4,000		+3,000		9:20 ノーオペ 10:10 国庫短期証券買入(5/9-) ▲0.009%按分(54.5%) 20,001億 国債買入(5/9-) (残存1年以下) ▲0.025%按分(53.1%) 701億 (残存10年超25年以下) ▲0.053%按分(32.4%) 2,404億 (残存25年超) ▲0.090%按分(34.4%) 1,601億 12:50 ノーオペ 13:00 共通担保(全店)(固定金利) (5/9-5/23) 0%全取 2,880億 13:50 国債補完供給(5/2-5/6) ▲0.600%全取 68億
財政	▲24,800		▲8,900		▲35,000		▲4,000		
過不足	▲24,900		▲6,400		▲31,000		▲1,000		
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									
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲9,700	+1,800			▲3,200	+2,900			
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲800						
社債等買入				+100					
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+300	▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲33,100		▲7,000		▲6,600		▲1,000		
当座預金残高	2,811,000		2,804,000		2,797,400		2,796,400		
準備預金残高	2,536,800		2,083,600		2,083,600		2,083,600		
積み終了先	2,083,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		
超過準備	2,083,400		2,083,400		2,083,400		2,083,400		
非準備預金残高	274,200		274,200		274,200		274,200		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	66.7%		66.7%		66.7%		66.7%		
乖離率	33.2%		33.2%		33.2%		33.2%		
共通担保オベ当社予想	0		0		0		0		
共通担保(本店)	0		0		0		0		
共通担保(全店)	58,409		58,409		58,409		58,409		
国債買現先	0		0		0		0		
CP買現先	0		0		0		0		
成長基盤強化	63,410		63,410		63,410		63,410		
被災地金融機関支援	3,144		3,144		3,144		3,144		
ロンハート残高	0		0		0		0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,046,800
5/6以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 900
5/6以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.065	-	-0.100	-0.090
ビッド	-0.075	-	0.000	-0.075
出来値	-	-	-	-

4/28 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,861,900**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	4/20
長期国債	202	282	308
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	7.7
J-REIT	0.18	0.27	0.30
貸出支援基金	25	31	32
国庫短期証券	49	43	46
その他とも資産計	300	383	410
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	285
その他とも負債・純資産計	300	383	410

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
4/27	604(3M)	-0.2284%	-0.2473%
4/21	603(3M)	-0.1924%	-0.2044%
4/18	602(1Y)	-0.2045%	-0.2155%

4/28 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	61,063	+7,771	+2,814
	14,327	+2,814	
	46,736	+4,957	

*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	-	-	-0.070	-0.065	-	-	-	-	-	-
最高	0.000	-	-	0.000	-0.060	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.067	-	-	-0.057	-0.062	-	0.000	-	-	-	-
東京レボレート	-0.074	-0.076	-	-0.109	-0.117	-0.123	-0.135	-	-0.193	-0.206	-0.213

5/6 オファターのオペと市場動向予想

6日の足許金利は引き続き、▲0.08～▲0.04%で取引されよう。共通担保オベはノーオペを予想する。

5/6 の予定(国内)

8:50 4月マネタリーベース(日銀)
10:00 4/30現在の営業毎旬報告(日銀)

5/6 の予定(海外)

米 4月の雇用統計
3月消費者信頼感

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
◎	ノーオペ	▲7,000	2,804,000	+2,804,000	-0.086	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080
					0.000	0.000	0.000	0.000	0.001	0.001	0.001	0.001

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		
2016/5/9 ~ 2016/5/23	8,000	2,880	2,880	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		
2016/5/2 ~ 2016/5/16	8,000	1,780	1,780	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		
2016/5/2 ~ 2016/8/12	15,000	50	50	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		
2016/4/28 ~ 2016/8/9	15,000	80	80	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		
2016/4/25 ~ 2016/5/9	8,000	3,230	3,230	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ									
2016/4/18 ~ 2016/5/2	8,000	3,210	3,210	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		
2016/4/11 ~ 2016/4/25	8,000	580	580	0.00%	固定金利	-	札割れ	4/28 ~ 5/12	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	-	札割れ		
2016/4/4 ~ 2016/4/18	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	-	札割れ	4/21 ~ 4/28	担保範囲内	0	0	0.860%	固定金利	-	札割れ		

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