

DAILY SIGNAL

平成28年5月6日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは207兆7,000億円。
本日の無担保コールON物は▲0.065%の出会いから始まり、
その後は▲0.075～▲0.05%で取引された。
ショートタームでは▲0.06%近辺での出会いとなった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,077,000	+2,077,000

(単位:億円)

	日銀速報 5/6(金)		日銀予想 5/9(月)		当社需給予想				5/6 のオペ結果
					5/10(火)		5/11(水)		
券	+2,900		+3,500		+3,000		+3,000		9:20
財政	▲7,700		▲23,500		▲4,000		▲2,000		ノーオペ
過不足	▲4,800		▲20,000		▲1,000		+1,000		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				+5,700					11:50
国庫短期証券買入				+20,000					国債補完供給(5/6-5/9)
国債買現先									▲0.600%全取 396億
共通担保(本店)			▲3,200	+2,900					
共通担保(全店)									12:50
CP買現先			▲300						ノーオペ
CP等買入	▲800								13:00
社債等買入									ノーオペ
ETF買入		+100		+200					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+100	▲500	+500						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲5,900		+5,800		▲1,000		+1,000		
当座預金残高	2,805,100		2,810,900		2,809,900		2,810,900		
準備預金残高	2,530,000								
積み終了先	2,077,400								
超過準備	2,077,400								
非準備先残高	275,100								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	76.7%		予想込増減		+5,800	予想込増減	▲1,000	予想込増減	+1,000
乖離率	23.2%		当預見込		2,810,900	当預見込	2,809,900	当預見込	2,810,900
									ロンバート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,046,800
5/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 500
5/9 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	-0.100
ビッド	-0.075	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

5/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,828,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	4/30
長期国債	202	282	312
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	7.8
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	47
その他とも資産計	300	383	414
銀行券	93	98	97
当座預金	178	253	284
その他とも負債・純資産計	300	383	414

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%

5/2 のコール市場残高(前日比)			
合計	63,701	+2,638	
有担	19,103	+4,776	
無担	44,598	-2,138	

*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	-	-	-0.065	-	-	0.030	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	0.080	-	-	-	-
加重平均	-0.066	-	-	-0.045	0.010	-	0.044	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.081	-0.085	-	-0.102	-0.109	-0.116	-0.125	-	-0.191	-0.206	-0.214

5/9 オファーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は引き続き、▲0.08～▲0.04%で取引
されよう。共通担保オペはノーオペを予想する。

5/9 の予定(国内)

8:50 3/14-15の政策決定会合議事要旨(日銀)
9:00 3月の毎月勤労統計速報(厚労省)
14:00 4月の消費動向調査(内閣府)

5/9 の予定(海外)

米 FRBの4月の労働市場情勢指数
ミナポリス連銀総裁の講演

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想							
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
◎ ノーオペ	+5,800	2,810,900	+2,810,900	-0.086	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080
				～	～	～	～	～	～	～	～
				0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.001	0.001	0.001

共通担保資金供給(全店)						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	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート
2016/5/9 ～ 2016/5/23	8,000	2,880	2,880	0.00%	固定金利	2015/11/18 ～ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%
2016/5/2 ～ 2016/5/16	8,000	1,780	1,780	0.00%	固定金利	2012/6/5 ～ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%
2016/5/2 ～ 2016/8/12	15,000	50	50	0.00%	固定金利	2012/6/1 ～ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%
2016/4/28 ～ 2016/8/9	15,000	80	80	0.00%	固定金利	2012/4/20 ～ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%
2016/4/25 ～ 2016/5/9	8,000	3,230	3,230	0.00%	固定金利	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	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート
2016/4/11 ～ 2016/4/25	8,000	580	580	0.00%	固定金利	4/28 ～ 5/12	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利
2016/4/4 ～ 2016/4/18	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	4/21 ～ 4/28	担保範囲内	0	0	0.860%	固定金利

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