

DAILY SIGNAL

平成28年5月16日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは206兆8,000億円。
新積み期となる本日の無担保コールON物は▲0.065%の出合いから始まり、
その後は▲0.086～▲0.04%で取引された。後場に入り、調整程度の出合いが
散見され引けた。無担保コールON物加重平均金利は▲0.063% (先週末対比▲0.008%)
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	-	-	2,068,000	+2,068,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/16 のオペ結果
	5/16(月)		5/17(火)		5/18(水)		5/19(木)		
券	+2,000		+1,300		+0		▲1,000		9:20
財政	▲18,100		+5,600		+1,000		▲25,000		ノーオペ
過不足	▲16,100		+6,900		+1,000		▲26,000		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				+9,200					11:50
国庫短期証券買入				+30,000					国債補完供給(5/16-5/17)
国債買現先									▲0.600%全取 24億
共通担保(本店)	▲1,800	+2,800							12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲1,200		▲100						ノーオペ
社債等買入									13:50
ETF買入		+300		+100					国債補完供給(5/16-5/17)
J-REIT買入									▲0.600%全取 33億
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		▲100		+100					
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲16,100		+46,200		+1,000		▲26,000		
当座預金残高	2,772,500		2,818,700		2,819,700		2,793,700		
準備預金残高	2,505,900								共通担保オベ当社予想
積み終了先	794,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店)
超過準備	592,600								共通担保(全店)
非準備先残高	266,600								国債買現先
準備預金進捗率	68.4%								CP買現先
平均	3.2%		予想込増減	+46,200	予想込増減	+1,000	予想込増減	▲26,000	成長基盤強化
乖離率	65.2%		当預見込	2,818,700	当預見込	2,819,700	当預見込	2,793,700	被災地金融機関支援
									ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,132,500
5/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 674,100
5/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 22,500

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.010	-	-0.100	-0.085
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.070
出来値	-	-	-	-

5/13 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,790,100**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	5/10
長期国債	202	282	312
CP等	2.2	2.2	1.9
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	48
その他とも資産計	300	383	415
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	281
その他とも負債・純資産計	300	383	415

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
5/12	607(3M)	-0.2204%	-0.2313%
5/11	606(6M)	-0.2819%	-0.2939%
5/10	605(3M)	-0.2197%	-0.2375%

5/13 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	69,241	16,727	52,514
	+3,712	+3,076	+636

*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	-	-	-	-0.001	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.100	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.063	-	-	0.250	0.033	-	0.100	-0.020	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.076	-	-0.093	-0.100	-0.108	-0.114	-	-0.199	-0.205	-0.216

5/17 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.086～▲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。

5/17 の予定(国内)

8:50 3月のマネタリーサーベイ(日銀)
13:30 3月の鉱工業生産確報(経産省)
16:00 4月の投信概況(投信協会)

5/17 の予定(海外)

米 4月の住宅着工件数
4月の消費者物価

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	+46,200	2,818,700	+2,818,700	-0.086	-0.070	-0.070	-0.070	-0.070	-0.070	-0.070	-0.070
				0.000	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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/5/16 ~ 2016/5/30	8,000	2,830	2,830	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/5/9 ~ 2016/5/23	8,000	2,880	2,880	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/5/2 ~ 2016/5/16	8,000	1,780	1,780	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/5/2 ~ 2016/8/12	15,000	50	50	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/4/28 ~ 2016/8/9	15,000	80	80	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/4/25 ~ 2016/5/9	8,000	3,230	3,230	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/4/18 ~ 2016/5/2	8,000	3,210	3,210	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/4/11 ~ 2016/4/25	8,000	580	580	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	按分率	平均レート	倍率
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%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

米ドル資金供給オベ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
5/12 ~ 5/19	担保範囲内	1	1	0.870%	固定金利	- 1.00
4/28 ~ 5/12	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	- 応れなし

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