

DAILY SIGNAL

平成28年5月18日(水)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

5/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは210兆円。
本日の無担保コールON物は▲0.065%の出合から始まり、その後は
▲0.065～▲0.045%のレンジで取引された。後場に入り、調整程度の出合が
散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,100,000	+2,100,000

(単位:億円)

	日銀速報 5/18(水)		日銀予想 5/19(木)		当社需給予想				5/18 のオペ結果
	5/18(水)		5/19(木)		5/20(金)		5/23(月)		
券	+700		▲300		▲1,000		+0		9:20
財政	+2,900		▲28,500		▲19,000		▲8,000		ノーオペ
過不足	+3,600		▲28,800		▲20,000		▲8,000		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	国債買入(5/20-)
国債買入						+12,400			(1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.007%按分(28.4%) 3,502億
国債買現先									(3年超5年以下)
共通担保(本店)									+0.005%按分(45.0%) 4,409億
共通担保(全店)									(5年超10年以下)
CP買現先									+0.005%按分(79.0%) 4,507億
CP等買入	▲200		▲200				▲5,200		10:40
社債等買入								+4,000	CP買入(5/23-)
ETF買入									▲0.001%按分(65.8%) 3,984億
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(5/18-5/19)
貸出	+200	▲200	+200						▲0.600% 全取 173億
国債補完供給									12:50
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	+3,400		▲28,800		▲7,600		▲9,200		
当座預金残高	2,822,100		2,793,300		2,785,700		2,776,500		
準備預金残高	2,552,300								共通担保(本店)
積み終了先	2,025,400								共通担保(全店)
超過準備	1,988,100								国債買現先
非準備預金残高	269,800								CP買現先
準備預金進捗率	93.4%								成長基盤強化
平均	9.7%		予想込増減 ▲28,800		予想込増減 ▲7,600		予想込増減 ▲1,200		被災地金融機関支援
乖離率	83.7%		当預見込 2,793,300		当預見込 2,785,700		当預見込 2,784,500		ロンバート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,132,500
5/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 140,300
5/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 5,000

	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	-0.070
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.055
出来値	-	-	-	-

5/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,816,700

(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
5/18	608(1Y)	-0.3152%	-0.3251%
5/12	607(3M)	-0.2204%	-0.2313%
5/11	606(6M)	-0.2819%	-0.2939%

5/17 のコール市場残高(前日比)

合計	60,193	+3,531
有担	14,737	-1,325
無担	45,456	+4,856

*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	-0.060	-	-0.050	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.010	-0.015	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.059	-0.058	-	-0.043	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.074	-0.066	-	-0.090	-0.097	-0.105	-0.112	-	-0.197	-0.208	-0.215

5/19 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。
共通担保オペは8,000億円がロールオファーされると予想する。

5/19 の予定(国内)

8:50 3月の機械受注(内閣府)

5/19 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
4月景気先行指数
NY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
◎ ノーオペ	▲28,800	2,793,300	+2,793,300	-0.086	-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

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	按分レート	平均レート	按分率	倍率			期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率		
2016/5/16 ～ 2016/5/30	8,000	2,830	2,830	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		
2016/5/9 ～ 2016/5/23	8,000	2,880	2,880	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 ～ 2016/5/16	8,000	1,780	1,780	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		
2016/5/2 ～ 2016/8/12	15,000	50	50	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		
2016/4/28 ～ 2016/8/9	15,000	80	80	0.00%	固定金利	-	札割れ			米ドル資金供給オペ									
2016/4/25 ～ 2016/5/9	8,000	3,230	3,230	0.00%	固定金利	-	札割れ			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		
2016/4/18 ～ 2016/5/2	8,000	3,210	3,210	0.00%	固定金利	-	札割れ			5/19 ～ 5/26	担保範囲内	1	1	0.860%	固定金利	-	1.00		
2016/4/11 ～ 2016/4/25	8,000	580	580	0.00%	固定金利	-	札割れ			5/12 ～ 5/19	担保範囲内	1	1	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