

DAILY SIGNAL

平成28年5月20日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは206兆4,000億円。
週末となる本日の無担保コールON物は▲0.050%の出合から始まり、その後は▲0.050～▲0.040%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	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,064,000	+2,064,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/20 のオペ結果
	5/20(金)		5/23(月)		5/24(火)		5/25(水)		
券	▲300		+700		+0		▲1,000		9:20
財政	▲19,500		▲5,400		+1,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲19,800		▲4,700		+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	国庫短期証券買入(5/24-)
国債買入		+12,600				+11,900			+0.000%按分(84.0%) 30,003億
国庫短期証券買入						+30,000			国債買入(5/24-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲5,200	+5,600					▲0.003%按分(89.4%) 3,506億
共通担保(全店)									(残存3年超5年以下)
CP買現先									▲0.010%按分(45.7%) 4,409億
CP等買入	▲700		▲100	+4,000					(残存10年超25年以下)
社債等買入									▲0.023%按分(49.8%) 2,402億
ETF買入									(残存25年超)
J-REIT買入		+100							▲0.041%按分(60.2%) 1,601億
被災地金融機関支援貸出									11:50
国債補完供給	+200								国債補完供給(5/20-5/23)
成長基盤強化支援貸出増加支援									▲0.600% 全取 28億
当座預金増減	▲7,600		▲400		+42,900		+1,000		12:50
当座預金残高	2,785,400		2,785,000		2,827,900		2,828,900		ノーオペ
準備預金残高	2,514,100		2,051,900		共通担保オペ当社予想		共通担保オペ当社予想		13:50
積み終了先	2,044,800		271,300		ノーオペ		ノーオペ		国債補完供給(5/20-5/23)
超過準備	271,300		98.1%		予想込増減 ▲400		予想込増減 +42,900		▲0.600% 全取 11億
非準備先残高	98.1%		22.6%		予想込増減 ▲400		予想込増減 +42,900		共通担保(本店) 0
準備預金進捗率	22.6%		75.5%		当預見込 2,785,000		当預見込 2,827,900		共通担保(全店) 58,409
乖離率	75.5%				当預見込 2,785,000		当預見込 2,827,900		国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 63,410
									被災地金融機関支援 3,144
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,132,500
5/23以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 40,700
5/23以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,700

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
オフア	-0.010	-0.100
レボ	-0.060	0.000
ビッド	-	-
出来値	-	-

5/19 時点のマナタリーベース(単位:億円) **3,790,600**

(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
5/19	609(3M)	-0.2405%	-0.2489%
5/18	608(1Y)	-0.3152%	-0.3251%
5/12	607(3M)	-0.2204%	-0.2313%

5/19 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	62,116	+2,162	
有担	17,167	+272	
無担	44,949	+1,890	

*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	-0.045	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.000	-0.015	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	-0.033	-	-0.018	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.067	-0.059	-	-0.085	-0.091	-0.101	-0.109	-	-0.197	-0.208	-0.215

5/23 オフア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。
共通担保オペはノーオペを予想する。

5/23 の予定(国内)

13:30 3月の全産業活動指数(経産省)
14:00 3月の景気動向指数改定値(内閣府)
未定 5月の月例経済報告(内閣府)

5/23 の予定(海外)

米 5月の製造業PMI速報

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
◎	ノーオペ	▲400	2,785,000	+2,785,000	-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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/5/23 ~ 2016/6/6	8,000	5,591	5,591	0.00%	固定金利	- 札割れ
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 ~ 2016/6/12	15,000	50	50	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/4/28 ~ 2016/6/9	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

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	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%

米ドル資金供給オペ

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
5/19 ~ 5/26	担保範囲内	1	1	0.860%	固定金利	- 1.00
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ありません。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