

DAILY SIGNAL

平成28年5月25日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/25 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは210兆3,000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.03%の割合から始まり、その後は▲0.065~▲0.03%のレンジで取引された。
後場入っても地合いは変わらず、▲0.06%近辺での割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	-	-	2,103,000	+2,103,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/25 のオペ結果
	5/25(水)		5/26(木)		5/27(金)		5/30(月)		
券	▲700		▲800		▲1,000		▲1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(5/25-) (1年超3年以下) +0.003%按分(4.0%) 3,505億 (3年超5年以下) +0.002%按分(12.0%) 4,406億 (5年超10年以下) +0.004%按分(27.6%) 4,507億 11:50 国債補完供給(5/25-5/26) ▲0.600%全取 86億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+500		+7,600		+1,000		+1,000		
過不足	▲200		+6,800		+0		▲2,000		
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	+5,300				+12,400				
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)							▲3,600		
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲100						
社債等買入	▲200								
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+100	▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+4,800		+6,800		+13,400		▲5,600		
当座預金残高	2,830,600		2,837,400		2,850,800		2,845,200		
準備預金残高	2,554,500								
積み終了先	2,096,900								
超過準備	2,096,100								
非準備先残高	276,100								
準備預金進捗率	99.0%								
平均	32.3%		予想込増減 +6,800		予想込増減 +13,400		予想込増減 +2,400		
乖離率	66.7%		当預見込 2,837,400		当預見込 2,850,800		当預見込 2,853,200		
			ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
							共通担保(本店) 0		
							共通担保(全店) 58,409		
							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
5/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 22,000
5/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,000

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.050	-
レボ	-0.100	-0.100
ビッド	-0.060	-
レボ	0.000	-0.090
出来値	-	-

5/24 時点のマナタリーベース(単位:億円) **3,823,900**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	5/20
長期国債	202	282	316
CP等	2.2	2.2	1.8
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	8.0
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	417
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	279
その他とも負債・純資産計	300	383	417

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%

5/24 のコール市場残高(前日比)

	合計	前日比
有担	63,113	+3,754
無担	17,604	+570
無担	45,509	+3,184

*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	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.010	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.055	-0.020	-	-0.035	0.001	0.100	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.083	-0.086	-	-0.095	-0.099	-0.105	-0.117	-	-0.199	-0.209	-0.215

5/26 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.086~▲0.03%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。

5/26 の予定(国内)

伊勢志摩サミット(27日まで)
8:50 4月の企業向けサービス価格(日銀)
対外対内証券売買契約等の状況(日銀)

5/26 の予定(海外)

米 ハウエルFRB理事の講演
4月耐久財受注
新規失業保険申請件数

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
◎ ノオベ	+6,800	2,837,400	+2,837,400	-0.086	-0.070	-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
2016/5/23 ~ 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%

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
5/26 ~ 6/3	担保範囲内	1	1	0.860%	固定金利	- 1.00
5/19 ~ 5/26	担保範囲内	1	1	0.860%	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