

DAILY SIGNAL

平成28年5月26日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは210兆5,000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まり、その後は
▲0.07~▲0.03%のレンジで取引された。
後場においては、調整程度の出合が見られ、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	-	-	2,105,000	+2,105,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/26 のオペ結果
	5/26(木)		5/27(金)		5/30(月)		5/31(火)		
券	▲1,000		▲1,100		▲1,000		+400		9:20
財政	+7,400		+2,300		▲1,000		+2,000		ノーオペ
過不足	+6,400		+1,200		▲2,000		+2,400		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				+12,700					10:40
国庫短期証券買入									CP買入(5/31-)
国債買現先									▲0.014%按分(48.8%) 4,495億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)					▲3,600	+2,500			国債補完供給(5/26-5/27)
CP買現先									▲0.600%全取 3億
CP等買入	▲100		▲400						12:50
社債等買入				+1,000					ノーオペ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									共通担保(全店)×(固定金利)
被災地金融機関支援									(5/30-6/13)
貸出									0%全取 2,500億
国債補完供給	+100								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+6,400		+14,500		▲3,100		+6,900		
当座預金残高	2,837,000		2,851,500		2,848,400		2,855,300		
準備預金残高	2,555,800		2,555,800		2,555,800		2,555,800		
積み終了先	2,098,200		2,098,200		2,098,200		2,098,200		共通担保(本店) 0
超過準備	2,098,200		2,098,200		2,098,200		2,098,200		共通担保(全店) 58,409
非準備預金残高	281,200		281,200		281,200		281,200		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.2%		99.2%		99.2%		99.2%		CP買現先 0
平均	35.5%		35.5%		35.5%		35.5%		成長基盤強化 63,410
乖離率	63.7%		63.7%		63.7%		63.7%		被災地金融機関支援 3,144
当座預金増減	+6,400		+14,500		▲3,100		+6,900		ローンハード残高 0
準備預金残高	2,837,000		2,851,500		2,848,400		2,855,300		
積み終了先	2,098,200		2,098,200		2,098,200		2,098,200		
超過準備	2,098,200		2,098,200		2,098,200		2,098,200		
非準備預金残高	281,200		281,200		281,200		281,200		
準備預金進捗率	99.2%		99.2%		99.2%		99.2%		
平均	35.5%		35.5%		35.5%		35.5%		
乖離率	63.7%		63.7%		63.7%		63.7%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,132,500
5/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 17,600
5/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 900

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.045	-0.100
レボ	-0.060	0.000
ビッド	-	-
出来値	-	-

5/25 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,829,500

(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
5/26	610(3M)	-0.2605%	-0.2729%
5/19	609(3M)	-0.2405%	-0.2489%
5/18	608(1Y)	-0.3152%	-0.3251%

5/25 のコール市場残高(前日比)			
合計	64,091		+978
有担	16,668		-936
無担	47,423		+1,914

*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	-0.085	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.000	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-	-	-0.030	0.200	-	-0.023	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.091	-	-0.097	-0.101	-0.108	-0.121	-	-0.200	-0.210	-0.217

5/27 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。
共通担保オペはノーオペを予想する。

5/27 の予定(国内)

オハマ米大統領が広島訪問
8:30 4月全国、5月都都部の消費者物価指数(総務省)
14:00 4月の基調的なインフレ率を補足するための指標速報(日銀)

5/27 の予定(海外)

米 1~3月のGDP改定値
5月のシカゴ大消費者信頼感確報
FRB議長がハーバード大学で講演

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	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	+14,500	2,851,500	+2,851,500	-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)					*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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/5/30 ~ 2016/6/13	8,000	2,500	2,500	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				
2016/5/23 ~ 2016/6/6	8,000	5,591	5,591	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				
2016/5/16 ~ 2016/5/30	8,000	2,830	2,830	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				
2016/5/9 ~ 2016/5/23	8,000	2,880	2,880	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				
2016/5/2 ~ 2016/5/16	8,000	1,780	1,780	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/5/2 ~ 2016/8/12	15,000	50	50	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/4/28 ~ 2016/8/9	15,000	80	80	0.00%	固定金利	-	札割れ	5/26 ~ 6/3	担保範囲内	1	1	0.860%	固定金利	-	1.00				
2016/4/25 ~ 2016/5/9	8,000	3,230	3,230	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				

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