

DAILY SIGNAL

平成28年5月31日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/31 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは214兆円だった。
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▲0.08～▲0.03%のレンジで取引された。月末要因等もあり、一巡後はビッドが徐々に薄くなり、後場の一部▲0.07%台の出合いが見られて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,140,000	+2,140,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/31 のオペ結果
	5/31(火)		6/1(水)		6/2(木)		6/3(金)		
券	+900		+700		+0		+0		9:20
財政	▲7,500		▲15,100		▲40,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲6,600		▲14,400		▲40,000		+2,000		11:50
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	国債補完供給(5/31-6/1)
国債買入		+5,400		+12,800					▲0.600%全取 254億
国庫短期証券買入		+20,000							
国債買現先									12:50
共通担保(本店)									ノーオペ
共通担保(全店)									13:00
CP買現先									ノーオペ
CP等買入	▲2,300	+4,500							13:50
社債等買入									国債補完供給(5/31-6/1)
ETF買入									▲0.600%全取 10億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+500	▲400	+400						
成長基盤強化支援貸出増加支援							▲2,200	+6,900	
当座預金増減	+21,100		▲1,200		▲40,000		+6,700		
当座預金残高	2,867,900		2,866,700		2,826,700		2,833,400		
準備預金残高	2,577,300								共通担保(本店)
積み終了先	2,128,800								共通担保(全店)
超過準備	2,128,800								国債買現先
非準備先残高	290,600								CP買現先
準備預金進捗率	99.6%								成長基盤強化
平均	51.6%		予想込増減	▲1,200	予想込増減	▲40,000	予想込増減	+6,700	被災地金融機関支援
乖離率	48.0%		当預見込	2,866,700	当預見込	2,826,700	当預見込	2,833,400	ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,129,200
6/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 8,300
6/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.020	-0.100
レボ	-0.070	0.000
ビッド	-0.070	-0.085
出来値	-	-

5/30 時点のマナターベース(単位:億円) 3,847,100

(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	回数	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%

5/30 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
5/30	65,615	16,243	49,372
5/29	66,143	16,243	49,899
前日比	-7,174	-1,232	-5,942

*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	-0.080	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-0.010	-	-0.028	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.088	-0.089	-	-0.100	-0.105	-0.114	-0.144	-	-0.202	-0.215	-0.221

6/1 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は▲0.08～0%のレンジを予想。
共通担保オペは期落ちなくノーオペを予想。

6/1 の予定(国内)

16:00 5月調査の債券市場サーベイ(日銀)

6/1 の予定(海外)

米 5月のISM製造業指数
4月の建設支出

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	▲1,200	2,866,700	+2,866,700	-0.080	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-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