

DAILY SIGNAL

平成28年6月1日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/6/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは214兆6,000億円だった。
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▲0.075～▲0.03%のレンジで取引された。一巡後は▲0.055～▲0.035%で出合い、後場にかけて▲0.06%の出合いが散見され引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,146,000	+2,146,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/1 のオペ結果
	6/1(水)		6/2(木)		6/3(金)		6/6(月)		
券	+600		+100		+0		+1,000		9:20
財政	▲15,500		▲49,000		+2,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲14,900		▲48,900		+2,000		+2,000		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(6/3-)
国債買入		+12,800			+4,300				(残存1年以下)
国庫短期証券買入									0.000%按分(71.0%) 704億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									+0.017%按分(47.4%) 2,202億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先									+0.033%按分(40.4%) 1,402億
CP等買入			▲200						10:40
社債等買入									米ドル資金供給
ETF買入									(6/3-6/9)
J-REIT買入									利率0.850% 0百万米ドル
被災地金融機関支援									11:50
貸出									国債補完供給(6/1-6/2)
国債補完供給	+400				▲2,200	+6,900	▲200	+0	▲0.600% 全取 21億
成長基盤強化支援									12:50
貸出増加支援									ノーオペ
									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	▲1,700		▲49,100		+11,000		▲4,000		
当座預金残高	2,866,200		2,817,100		2,828,100		2,824,100		
準備預金残高	2,591,800		2,591,800		2,591,800		2,591,800		
積み終了先	2,143,300		2,143,300		2,143,300		2,143,300		共通担保(本店) 0
超過準備	2,143,300		2,143,300		2,143,300		2,143,300		共通担保(全店) 58,409
非準備先残高	274,400		274,400		274,400		274,400		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.7%		99.7%		99.7%		99.7%		CP買現先 0
平均	54.8%		54.8%		54.8%		54.8%		成長基盤強化 63,410
乖離率	44.8%		44.8%		44.8%		44.8%		被災地金融機関支援 3,144
			予想込増減	▲49,100	予想込増減	+11,000	予想込増減	+4,000	ローンハート残高 0
			当預見込	2,817,100	当預見込	2,828,100	当預見込	2,832,100	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,129,200
6/2以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,400
6/2以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	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G.C	-0.090	-0.080
ビッド	-0.070	0.000
出来値	-	-

5/31 時点のマナターベース(単位:億円) 3,867,300

(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%

5/31のコール市場残高(前日比)

	合計	53,810	-11,805
有担	14,035	-2,208	
無担	39,775	-9,597	

*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	-0.015	-	0.000	-0.028	-	-0.030	-	-	-	-
東京レポレート	-0.084	-0.087	-	-0.099	-0.105	-0.115	-0.147	-	-0.202	-0.215	-0.221

5/6/2 オペのオペと市場動向予想

明日の足許金利は▲0.07～0%のレンジで取引される
だろう。共通担保オペは期落ちロールすると予想する。

6/2の予定(国内)

8:50 5月のマナターベース(日銀)
10:00 5月31日現在の営業毎旬報告(日銀)
14:00 5月の消費動向調査(内閣府)

6/2の予定(海外)

米 5月のADP雇用統計
欧 ECB理事会
ECB総裁の会見

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	▲49,100	2,817,100	+2,817,100	-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	6/3 ~ 6/9	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	-	応札なし				
2016/4/25 ~ 2016/5/9	8,000	3,230	3,230	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				

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