

DAILY SIGNAL

平成28年6月2日(木)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 6/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは209兆5,000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は▲0.06~▲0.03%のレンジで取引された。財政等要因もあり、一部では▲0.02%の調達も見られたものの、一巡後にビッドは薄くなり、後場にかけて▲0.07%台の出合いも散見され引けた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,095,000	+2,095,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/2 のオペ結果
	6/2(木)		6/3(金)		6/6(月)		6/7(火)		
券		+200		+200		+1,000		+1,000	9:20 ノオベ 11:50 国債補完供給(6/2-6/3) ▲0.600% 全取 10億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)\固定金利 (6/6-6/20) 0% 全取 3,350億
財政		▲49,300		+7,500		+1,000		+0	
過不足		▲49,100		+7,700		+2,000		+1,000	
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				+4,500					
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)					▲5,800	+3,400			
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲100						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給			▲3,900	+6,900	▲200	+0			
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減		▲49,300		+15,100		▲600		+1,000	
当座預金残高		2,816,900		2,832,000		2,831,400		2,832,400	
準備預金残高		2,542,800	共通担保オペ当社予想						共通担保(本店) 0
積み終了先		2,096,400	ノオベ						共通担保(全店) 20,671
超過準備		2,096,400	ノオベ						国債買現先 0
非準備先残高		274,100	ノオベ						CP買現先 0
準備預金進捗率		99.7%	ノオベ						成長基盤強化 63,410
平均		58.1%	予想込増減	+15,100	予想込増減	▲600	予想込増減	+1,000	被災地金融機関支援 4,212
乖離率		41.6%	当預見込	2,832,000	当預見込	2,831,400	当預見込	2,832,400	ローンハード残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,129,200
6/3以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 6,300
6/3以降の残り積み立て額(残り所要)平均) 500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)

	14年末実績	15年末実績	5/31
長期国債	202	282	319
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	8.0
J-REIT	0.18	0.27	0.31
貸出支援基金	25	31	32
国庫短期証券	49	43	51
その他とも資産計	300	383	426
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	287
その他とも負債・純資産計	300	383	426

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
6/2	611(3M)	-0.2545%	-0.2661%
5/26	610(3M)	-0.2605%	-0.2729%
5/19	609(3M)	-0.2405%	-0.2489%

6/1のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	69,426	+15,616	-3,262
	17,297	+3,262	
	52,129	+12,354	

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

	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	-0.065
出来値	-	-

6/1時点のマナターベース(単位:億円) **3,865,000**

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	-	-	-0.025	-0.023	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.010	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.055	-0.010	-	-0.005	-0.009	0.000	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.082	-0.081	-	-0.097	-0.103	-0.114	-0.150	-	-0.199	-0.215	-0.221

§ 6/3 オファター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。共通担保オペはノオベ予想。

6/3 の予定(国内)

9:00 4月の毎月勤労統計速報(厚労省)

6/3 の予定(海外)

米 5月の雇用統計
4月の貿易収支
5月のISM非製造業指数

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	+15,100	2,832,000	+2,832,000	-0.080	-0.040	-0.040	-0.040	-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
2016/6/6 ~ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	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
2016/5/30 ~ 2016/6/13	8,000	2,500	2,500	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
2016/5/23 ~ 2016/6/6	8,000	5,591	5,591	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
2016/5/16 ~ 2016/5/30	8,000	2,830	2,830	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
2016/5/9 ~ 2016/5/23	8,000	2,880	2,880	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/5/2 ~ 2016/5/16	8,000	1,780	1,780	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
2016/5/2 ~ 2016/8/12	15,000	50	50	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
2016/4/28 ~ 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

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。