

DAILY SIGNAL

平成28年6月7日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5 6/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは213兆3,000億円。
無担保コールON物は朝方▲0.03%の出合いからスタートし、
その後は▲0.06～▲0.025%のレンジで推移した。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,133,000	+2,133,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/7 のオペ結果
	6/7(火)		6/8(水)		6/9(木)		6/10(金)		
券	+1,200		+600		+0		▲1,000		9:20
財政	+4,400		+1,800		+0		▲8,000		ノーオペ
過不足	+5,600		+2,400		+0		▲9,000		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	ノーオペ
国債買入		+12,800							10:40
国庫短期証券買入		+10,000							米ドル資金供給(6/9-6/16)
国債買現先									貸付金利0.850% 1百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(6/7-6/8)
CP買現先									▲0.600% 全取 73億
CP等買入	▲400		▲100						12:50
社債等買入	▲200		▲100			+4,500			ノーオペ
ETF買入									13:00
J-REIT買入		+400		+400					ノーオペ
被災地金融機関支援									13:50
貸出									国債補完供給(6/7-6/8)
国債補完供給		▲100		+100					▲0.600% 全取 15億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+28,100		+2,700		+4,500		▲9,000		
当座預金残高	2,855,400		2,858,100		2,862,600		2,853,600		
準備預金残高	2,571,500								共通担保(本店)
積み終了先	2,129,900								共通担保(全店)
超過準備	2,129,900								国債買現先
非準備預金残高	283,900								CP買現先
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化
平均	74.2%		予想込増減 +2,700		予想込増減 +4,500		予想込増減 ▲9,000		被災地金融機関支援
乖離率	25.7%		当預見込 2,858,100		当預見込 2,862,600		当預見込 2,853,600		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,141,100
6/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,100
6/8以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.010	-0.100
レボ	-0.040	0.000
ビッド	-	-0.090
出来値	-	-

6/6 時点のマナターベース(単位:億円) 3,824,000

(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	回号	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%

6/6のコール市場残高(前日比)		
合計	71,886	-1,602
有担	18,594	+1,215
無担	53,292	-2,817

*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	-	-	-0.050	-0.030	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.010	0.230	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.049	0.000	-	-0.013	-0.006	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.085	-0.095	-	-0.099	-0.105	0.115	-0.156	-	-0.190	-0.214	-0.220

5 6/8 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.08～0.001%のレンジで推移しよう。
共通担保オペは見送られると予想する。

6/8 の予定(国内)

8:50 1～3月のGDP改定値(内閣府)
13:30 5月の倒産件数(帝国DB、商工リサーチ)

6/8 の予定(海外)

米 MBA住宅ローン申請指数

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	
◎	ノーオペ	+2,700	2,858,100	+2,858,100	-0.080	-0.040	-0.040	-0.040	-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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	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	オフア額	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	6/9 ~ 6/16	担保範囲内	1	1	0.850%	固定金利	-	1.00				
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	-	応れなし				

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。 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