

DAILY SIGNAL

平成28年6月9日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは212兆9,000億円。
無担ON物は朝方▲0.03%の出会いから始まり、その後は▲0.07～▲0.025%で推移した。
本日、日銀はマクロ加算残高の算出に用いる基準比率(2016年6月～8月積み期に適用)を7.5%とすること、同3積み期間における政策金利残高は平均して概ね10兆円台となる見込みであることを公表した。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,129,000	+2,129,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/9 のオペ結果
	6/9(木)		6/10(金)		6/13(月)		6/14(火)		
券	+0		+0		+0		+0		9:20
財政	▲2,800		▲8,200		▲1,000		▲2,000		ノーオペ
過不足	▲2,800		▲8,200		▲1,000		▲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	ノーオペ
国債買入				+9,600					11:50
国庫短期証券買入									国債補充供給(6/9-6/10)
国債買現先									▲0.500% 全取 3億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲2,500	+2,100			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入		+4,500	▲1,000						共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入			▲100						(6/13-6/27)
ETF買入				+400					0% 全取 2,081億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補充供給	+200								
成長基盤強化支援貸出増加支援									
熊本地震被災地支援									+400
当座預金増減	+1,900		+700		▲1,400		▲1,600		
当座預金残高	2,856,500		2,857,200		2,855,800		2,854,200		
準備預金残高	2,570,500		2,570,500		2,570,500		2,570,500		
積み終了先	2,131,000		2,131,000		2,131,000		2,131,000		
超過準備	2,131,000		2,131,000		2,131,000		2,131,000		
非準備預金残高	286,000		286,000		286,000		286,000		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	80.6%		80.6%		80.6%		80.6%		
乖離率	19.3%		19.3%		19.3%		19.3%		
共通担保オベ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
									共通担保(全店) 13,860
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 68,139
									被災地金融機関支援 4,212
									ロンバート残高 0

今積み期間の所要準備額(積数) 2,141,100
6/10以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,000
6/10以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.010	-
レボ	-0.100	-0.090
ビッド	-0.040	-
レボ	0.000	-0.080
出来値	-	-

6/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,849,600

(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
6/9	613(3M)	-0.2505%	-0.2629%
6/8	612(6M)	-0.3387%	-0.3505%
6/2	611(3M)	-0.2545%	-0.2661%

6/8のコール市場残高(前日比)			
合計	67,941	-4,574	
有担	16,236	-661	
無担	51,705	-3,913	

*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	-	-	-	0.010	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.200	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.050	-0.015	-	0.000	0.019	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.092	-	-0.102	-0.114	-0.154	-0.170	-	-0.190	-0.218	-0.222

§ 6/10 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。
共通担保オベは見送られると予想する。

6/10 の予定(国内)

8:50 5月の企業物価指数(日銀)
中曾日銀副総裁記者会見要旨

6/10 の予定(海外)

米 シガソ大消費着信頼感指数
欧 ECB副総裁講演

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想									
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	+700	2,857,200	+2,857,200	-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	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				
2016/6/13 ~ 2016/6/27	8,000	2,081	2,081	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				
2016/6/6 ~ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	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				
2016/5/30 ~ 2016/6/13	8,000	2,500	2,500	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				
2016/5/23 ~ 2016/6/6	8,000	5,591	5,591	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				
2016/5/16 ~ 2016/5/30	8,000	2,830	2,830	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ											
2016/5/9 ~ 2016/5/23	8,000	2,880	2,880	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 ~ 2016/5/16	8,000	1,780	1,780	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				
2016/5/2 ~ 2016/6/12	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