

DAILY SIGNAL

平成28年6月17日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは220兆5,000億円。
本日の無担ON物は朝方▲0.055%の出合いから始まり、その後は▲0.08～▲0.03%で推移した。
後場に入り、一部▲0.08%近辺の出合いが散見され引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,205,000	+2,205,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/17 のオペ結果
	6/17(金)		6/20(月)		6/21(火)		6/22(水)		
券	▲1,400		▲200		+0		▲1,000		9:20
財政	+100		+44,500		▲3,000		+0		ノーオペ
過不足	▲1,300		+44,300		▲3,000		▲1,000		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	国庫短期証券買入(6/21-)
国債買入		+12,500							+0.027%按分(69.8%) 17,500億
国庫短期証券買入						+17,500			11:50
国債買現先									国債補完供給(6/17-6/20)
共通担保(本店)			▲3,400	+4,200					▲0.60%全取 378億
共通担保(全店)									12:50
CP買現先			▲400	+4,500					ノーオペ
CP等買入	▲600		▲1,300						13:00
社債等買入									ノーオペ
ETF買入		+300							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+400	▲400	+400						
成長基盤強化支援			▲57,900	+68,700					
貸出増加支援									
当座預金増減	+10,900		+59,100		+14,500		▲1,000		
当座預金残高	2,949,100		3,008,200		3,022,700		3,021,700		
準備預金残高	2,657,400		2,182,400		共通担保オペ当社予想		共通担保オペ		共通担保(本店) 0
積み終了先	2,182,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 13,441
超過準備	2,042,100								国債買現先 0
非準備先残高	291,700								CP買現先 0
準備預金進捗率	97.4%								成長基盤強化 68,139
平均	13.3%		予想込増減 +59,100		予想込増減 +14,500		予想込増減 ▲1,000		被災地金融機関支援 4,581
乖離率	84.1%		当預見込 3,008,200		当預見込 3,022,700		当預見込 3,021,700		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064.500
6/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 53.400
6/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2.100

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.010	-	-0.100	-0.070
ビッド	-0.040	-	0.000	-0.050
出来値	-	-	-	-

6/16 時点のマナターベース(単位:億円) **3,934,300**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	6/10
長期国債	202	282	323
CP等	2.2	2.2	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	8.2
J-REIT	0.18	0.27	0.3
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	429
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	286
その他とも負債・純資産計	300	383	429

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
6/15	615(3M)	-0.2517%	-0.2636%
6/14	614(1Y)	-0.3587%	-0.3656%
6/9	613(3M)	-0.2505%	-0.2629%

6/16 のコール市場残高(前日比)			
合計	55,689	-	-17,226
有担	15,131	-	-2,177
無担	40,558	-	-15,049

*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	-0.086	-0.030	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.020	0.000	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.057	-0.015	-	0.001	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.075	-0.057	-	-0.091	-0.120	-0.130	-0.140	-	-0.188	-0.219	-0.221

§ 6/20 オファーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は▲0.085～▲0.03%で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

6/20 の予定(国内)

8:50 5月の貿易統計(財務省)
9:00 5月の公社債投資家別売買状況(日証協)
16:50 黒田日銀総裁講演-慶應義塾大学-

6/20 の予定(海外)

欧 ドラギ ECB総裁、欧州議会で発言
欧 EU外相理事会

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	+59,100	3,008,200	+3,008,200	-0.085	-0.050	-0.050	-0.050	-0.060	-0.060	-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
2016/6/20 ~ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	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
2016/6/13 ~ 2016/6/27	8,000	2,081	2,081	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
2016/6/6 ~ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	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
2016/5/30 ~ 2016/6/13	8,000	2,500	2,500	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
2016/5/23 ~ 2016/6/6	8,000	5,591	5,591	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/5/16 ~ 2016/5/30	8,000	2,830	2,830	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
2016/5/9 ~ 2016/5/23	8,000	2,880	2,880	0.00%	固定金利	-	札割れ	6/16 ~ 6/23	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	-	応札なし
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

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