

DAILY SIGNAL

平成28年6月20日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは223兆9,000億円。
本日の無担ON物は朝方▲0.035%の出し合いから始まり、
その後は▲0.08～▲0.03%で推移した。
後場に入っても地合いに変化は見られず引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,239,000	+2,239,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/20 のオペ結果
	6/20(月)		6/21(火)		6/22(水)		6/23(木)		
券	▲200		▲800		▲1,000		▲2,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(6/22-) (残存1年以下) ▲0.013%按分(70.0%) 700億 (5年超10年以下) +0.012%按分(53.7%) 4,505億 10:40 社債等買入(6/24-) ▲0.304%按分(37.7%) 1,300億 11:50 国債補完供給(6/20-6/21) ▲0.600%全取 141億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補完供給(6/20-6/21) ▲0.600%全取80億 共通担保(本店) 0 共通担保(全店) 14,322 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 4,581 ロンバート残高 0
財政	+43,600		▲5,100		+0		▲5,000		
過不足	+43,400		▲5,900		▲1,000		▲7,000		
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									
国庫短期証券買入				+17,600		+5,200			
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲3,400	+4,200							
CP買現先			▲300						
CP等買入	▲400	+4,500	▲100						
社債等買入	▲1,300								
ETF買入				+100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+400	▲300	+300						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援	▲57,900	+68,700							
当座預金増減	+57,900		+11,700		+4,200		▲7,000		
当座預金残高	3,007,000		3,018,700		3,022,900		3,015,900		
準備預金残高	2,727,300		2,228,800		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	2,228,800		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	2,223,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備預金残高	279,700		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	98.4%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	16.7%		予想込増減	+11,700	予想込増減	+4,200	予想込増減	▲7,000	
乖離率	81.7%		当預見込	3,018,700	当預見込	3,022,900	当預見込	3,015,900	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064,500
6/21以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 33,500
6/21以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,300

	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	-0.060
ビッド	-0.050	-
出来値	-	-

6/17 時点のマナタリーベース(単位:億円) **3,946,600**

(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
その他とも負債・純資産計	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	回数	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%

6/17 のコール市場残高(前日比)			
合計	67,322	+11,633	
有担	18,291	+3,160	
無担	49,031	+8,473	

*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	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.050	-	-	0.230	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.057	-0.010	-	0.021	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.064	-0.051	-	-0.087	-0.117	-0.125	-0.133	-	-0.186	-0.219	-0.221

§ 6/21 オフアのオペと市場動向予想

明日の足許金利は▲0.08～▲0.03%で取引されよう。
共通担保オペはノオベを予想する。

6/21 の予定(国内)

8:50 4月27・28日の金融政策決定会合
議事要旨(日銀)

6/21 の予定(海外)

米国 イェンFRB議長、上院証言

13:30 4月の全産業活動指数(経産省)

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出し合いレンジ予想								
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	+11,700	3,018,700	+3,018,700	-0.080	-0.050	-0.050	-0.050	-0.060	-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
2016/6/20 ~ 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	オフア額	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