

DAILY SIGNAL

平成28年6月21日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは224兆6,000億円。
本日の無担ON物は朝方▲0.04%の出合いから始まり、
その後は▲0.085～▲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	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,246,000	+2,246,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/21 のオペ結果
	6/21(火)		6/22(水)		6/23(木)		6/24(金)		
券	▲1,000		▲1,100		▲2,000		▲2,000		9:20
財政	▲6,500		▲800		▲5,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲7,500		▲1,900		▲7,000		+0		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				+5,300					10:40
国庫短期証券買入		+17,600							米ドル資金供給(6/23-6/30)
国債買現先									貸付金利0.880% 2百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(6/21-6/22)
CP買現先			▲200						▲0.600%全取 217億
CP等買入	▲300								12:50
社債等買入	▲100								ノーオペ
ETF買入		+100		+200					13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									13:50
貸出							▲500	+500	国債補完供給(6/21-6/22)
国債補完供給	+300	▲300	+300						▲0.600%全取 81億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+9,800		+3,700		▲7,000		+1,300		
当座預金残高	3,016,800		3,020,500		3,013,500		3,014,800		
準備預金残高	2,724,700		2,228,100		共通担保オペ当社予想		共通担保(本店)		0
積み終了先	2,228,000		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 14,322
超過準備	2,228,000								国債買現先 0
非準備預金残高	292,100								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.0%								成長基盤強化 68,139
平均	20.0%		予想込増減 +3,700		予想込増減 ▲7,000		予想込増減 +1,300		被災地金融機関支援 4,581
乖離率	79.0%		当預見込 3,020,500		当預見込 3,013,500		当預見込 3,014,800		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064.500
6/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 20,000
6/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 800

	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
レボ	-0.050	-0.040
ビッド	-0.050	0.000
出来値	-	-

6/20 時点のマナターベース(単位:億円) 4,004,700

(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%

6/20 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
6/20	69,720	20,520	49,200
6/19	+2,399	+2,229	+169

*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	-0.085	-	-	-0.050	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.010	-	-	0.230	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.059	-0.020	-	-0.029	-	-	-0.040	-	-	-	-
東京レポレート	-0.055	-0.046	-	-0.083	-0.110	-0.113	-0.122	-	-0.180	-0.217	-0.220

§ 6/22 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は▲0.085～▲0.03%で取引されよう。 10:00 6月20日現在の営業毎旬報告(日銀)

共通担保オペはノーオペを予想する。

6/22 の予定(海外)

米国 イレブンFRB議長、下院証言
中古住宅販売件数(5月)
週間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	+3,700	3,020,500	+3,020,500	-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	0.000	0.000	0.000	0.000

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/6/20 ~ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	0.00%	固定金利	札割れ
2016/6/13 ~ 2016/6/27	8,000	2,081	2,081	0.00%	固定金利	札割れ
2016/6/6 ~ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	0.00%	固定金利	札割れ
2016/5/30 ~ 2016/6/13	8,000	2,500	2,500	0.00%	固定金利	札割れ
2016/5/23 ~ 2016/6/6	8,000	5,591	5,591	0.00%	固定金利	札割れ
2016/5/16 ~ 2016/5/30	8,000	2,830	2,830	0.00%	固定金利	札割れ
2016/5/9 ~ 2016/5/23	8,000	2,880	2,880	0.00%	固定金利	札割れ
2016/5/2 ~ 2016/5/16	8,000	1,780	1,780	0.00%	固定金利	札割れ

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
6/23 ~ 6/30	担保範囲内	2	2	0.880%	固定金利	-
6/16 ~ 6/23	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	-

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