

DAILY SIGNAL

平成28年6月22日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/22 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%の出しから始まり、
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	-	-	2,246,000	+2,246,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/22 のオペ結果
	6/22(水)		6/23(木)		6/24(金)		6/27(月)		
券	▲1,100		▲2,300		▲2,000		+0		9:20
財政	▲1,100		▲5,000		+2,000		▲9,000		ノオペ
過不足	▲2,200		▲7,300		+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	国債買入(6/24-)
国債買入		+5,300				+13,400			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.002%按分(98.9%) 3,505億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									+0.001%按分(45.0%) 4,405億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.001%按分(91.3%) 4,503億
CP等買入	▲200		▲200						(変動利付債)
社債等買入			▲100			+1,300			+0.030円按分(51.6%) 1,000億
ETF買入				+100					11:50
J-REIT買入		+200							国債補完供給(6/22-6/23)
被災地金融機関支援					▲500	+500			▲0.600%全取 15億
貸出									12:50
国債補完供給	+300								ノオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノオペ
当座預金増減	+3,400		▲7,500		+14,700		▲11,700		
当座預金残高	3,020,200		3,012,700		3,027,400		3,016,300		
準備預金残高	2,732,200		2,732,200		2,732,200		2,732,200		
積み終了先	2,243,400		2,243,400		2,243,400		2,243,400		共通担保(本店) 0
超過準備	2,242,300		2,242,300		2,242,300		2,242,300		共通担保(全店) 14,322
非準備先残高	288,000		288,000		288,000		288,000		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.4%		99.4%		99.4%		99.4%		CP買現先 0
平均	23.3%		23.3%		23.3%		23.3%		成長基盤強化 68,139
乖離率	76.1%		76.1%		76.1%		76.1%		被災地金融機関支援 4,581
			予想込増減 ▲7,500	予想込増減 ▲7,500	予想込増減 +14,700	予想込増減 +14,700	予想込増減 ▲3,100	予想込増減 ▲3,100	ロンバート残高 0
			当預見込 3,012,700	当預見込 3,012,700	当預見込 3,027,400	当預見込 3,027,400	当預見込 3,024,300	当預見込 3,024,300	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064.500
6/23以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 11,600
6/23以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	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	-0.050	0.000
ビッド	-	-0.070
出来値	-	-

6/21 時点のマナターベース(単位:億円) **4,015,400**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	6/20
長期国債	202	282	320
CP等	2.2	2.2	2.6
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	3.8	6.9	8.3
J-REIT	0.18	0.27	0.32
貸出支援基金	25	31	33
国庫短期証券	49	43	50
その他とも資産計	300	383	426
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	301
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
6/15	615(3M)	-0.2517%	-0.2636%
6/14	614(1Y)	-0.3587%	-0.3656%
6/9	613(3M)	-0.2505%	-0.2629%

6/21 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	70,168	+448	
	20,163	-357	
	50,005	+805	

*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	-0.060	-	-0.040	0.000	-	-	-	-	-	-
最高	-0.010	-0.020	-	-0.038	0.090	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.061	-0.059	-0.010	-0.039	0.030	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.050	-0.049	-	-0.100	-0.105	-0.109	-0.117	-	-0.178	-0.218	-0.220

§ 6/23 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8,000億円のロールを予想する。

6/23 の予定(国内)

木内日銀審議委員講演

6/23 の予定(海外)

英国 EU離脱を問う国民投票
米国 週間新規失業保険申請件数
製造業PMI速報(6月)、新築住宅販売件数(5月)

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
◎ ノオペ	▲7,500	3,012,700	+3,012,700	-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	0.000	0.000	0.000	0.000

共通担保資金供給(全店)

期間	オフア額	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

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	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	オフア額	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	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