

DAILY SIGNAL

平成28年6月23日(木)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 6/23 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	-	-	2,236,000	+2,236,000

(単位:億円)

日銀速報 6/23(木)		日銀予想 6/24(金)		当社需給予想				6/23 のオペ結果
6/23(木)		6/24(金)		6/27(月)		6/28(火)		
券	▲2,200		▲1,800	+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲5,000		+6,900	▲9,000		+1,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲7,200		+5,100	▲9,000		+1,000		11:50
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				+13,700				
国庫短期証券買入								
国債買現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)					▲2,100	+4,100	▲6,600	
CP買現先			▲1,300					
CP等買入	▲200		▲200	+1,300				
社債等買入	▲100			+1,100				
ETF買入		+100						
J-REIT買入								
被災地金融機関支援			▲500	+500				
貸出								
国債補完供給								
成長基盤強化支援								
貸出増加支援								
当座預金増減	▲7,400		+19,700		▲7,000		▲5,600	
当座預金残高	3,012,800		3,032,500		3,025,500		3,019,900	
準備預金残高	2,716,200				共通担保オペ当社予想			
積み終了先	2,233,600		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +15,000	
超過準備	2,232,700							
非準備預金残高	296,600							
準備預金進捗率	99.6%							
平均	26.7%		予想込増減 +19,700		予想込増減 ▲7,000		予想込増減 +9,400	
乖離率	73.0%		当預見込 3,032,500		当預見込 3,025,500		当預見込 3,034,900	

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

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064,500
6/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,700
6/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	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	-0.060
ビッド	-0.040	-	0.000	-0.050
出来値	-	-	-	-

6/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,019,900

(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
6/23	616(3M)	-0.2224%	-0.2441%
6/15	615(3M)	-0.2517%	-0.2636%
6/14	614(1Y)	-0.3587%	-0.3656%

6/22 のコール市場残高(前日比)		
合計	67,781	-2,387
有担	20,609	+446
無担	47,172	-2,833

*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	-	-	-	-	-0.040	-	-	-	-	-
最高	-0.030	-	-	-	-	0.000	-	-	-	-	-
加重平均	-0.061	-0.020	-	-	-	-0.017	0.030	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.060	-0.071	-	-0.099	-0.102	-0.106	-0.111	-	-0.173	-0.213	-0.216

§ 6/24 オファタ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。
共通担保オペは15,000億円のロールを予想する。

6/24 の予定(国内)

未定 木内日銀審議委員会記者会見要旨
8:50 金融政策決定会合における主な意見(6月15・16日分)
15:30 中曽日銀副総裁挨拶

6/24 の予定(海外)

米国 シカゴ大消費信頼感確報(6月)
独 IFO景況感指数(6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
◎ ノーオペ	+19,700	3,032,500	+3,032,500	-0.085	-0.050	-0.050	-0.050	-0.060	-0.060	-0.060
				～	～	～	～	～	～	～
				0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000

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	按分レート	平均レート	按分率	倍率			期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率		
2016/6/27 ～ 2016/7/11	8,000	4,130	4,130	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		
2016/6/20 ～ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	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		
2016/6/13 ～ 2016/6/27	8,000	2,081	2,081	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		
2016/6/6 ～ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	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		
2016/5/30 ～ 2016/6/13	8,000	2,500	2,500	0.00%	固定金利	-	札割れ			米ドル資金供給オペ									
2016/5/23 ～ 2016/6/6	8,000	5,591	5,591	0.00%	固定金利	-	札割れ			期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率		
2016/5/16 ～ 2016/5/30	8,000	2,830	2,830	0.00%	固定金利	-	札割れ			6/23 ～ 6/30	担保範囲内	2	2	0.880%	固定金利	-	1.00		
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