

DAILY SIGNAL

平成28年6月24日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは225兆4,000億円。
本日の無担ON物は朝方▲0.04%の出合からスタートし、その後の出合水準は▲0.08～▲0.03%となった。
3日積みではあったが、昨日に引き続き調達意欲は低調で、後場は非常に閑散としていた。
英BBCによると、EU離脱の是非を問う英国の国民投票で、
離脱派が大勢を占める見込みと報道された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,254,000	+2,254,000

(単位:億円)

	日銀速報 6/24(金)		日銀予想 6/27(月)		当社需給予想				6/24 のオペ結果
	エンド	スタート	エンド	スタート	6/28(火)		6/29(水)		
券		▲1,800		▲100		+0		▲1,000	9:20 ノオベ
財政		+3,000		▲18,300		+1,000		+0	10:10 ノオベ
過不足		+1,200		▲18,400		+1,000		▲1,000	国庫短期証券買入(6/28-)
金融調節					エンド	スタート	エンド	スタート	+0.002%按分(13.4%) 15,001億
国債買入		+13,700							国債買入(6/28-)
国庫短期証券買入						+11,500			(1年超3年以下)
国債買現先						+15,000			▲0.020%按分(31.6%) 3,501億
共通担保(本店)			▲2,100	+4,100	▲6,600	+100			(3年超5年以下)
共通担保(全店)									▲0.027%按分(32.5%) 4,402億
CP買現先			▲800						(残存10年超25年以下)
CP等買入	▲1,300								▲0.054%(80.3%) 2,200億
社債等買入	▲200	+1,300							(残存25年超)
ETF買入		+1,100							▲0.088%(20.0%) 1,402億
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援	▲500	+500							国債補完供給(6/24-6/27)
貸出				+600					▲0.60%全取 543億
国債補完供給									12:50
成長基盤強化支援									ノオベ
貸出増加支援									13:00
									共通担保(全店)〈固定金利〉
									(6/28-10/7)
									0%全取 50億
当座預金増減		+15,200		▲16,600		+21,000		▲1,000	共通担保(本店) 0
当座預金残高		3,028,000		3,011,400		3,032,400		3,031,400	共通担保(全店) 14,322
準備預金残高		2,733,900							国債買現先 0
積み終了先		2,253,900							CP買現先 0
超過準備		2,253,700							成長基盤強化 68,139
非準備先残高		294,100							被災地金融機関支援 4,581
準備預金進捗率		99.8%							ロンハート残高 0
平均		36.7%	予想込増減	▲16,600	予想込増減	+21,000	予想込増減	▲1,000	
乖離率		63.1%	当預見込	3,011,400	当預見込	3,032,400	当預見込	3,031,400	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064.500
6/27 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 4,900
6/27 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
レボ	-	0.000
ビット	-	-0.065
出来値	-	-

6/23 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,014,700

(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%

6/23 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
6/23	69,259	+1,478	+554
6/22	21,163	-	+554
6/21	48,096	-	+924

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.030	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.062	-0.020	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.069	-0.060	-	-0.101	-0.103	-0.110	-0.114	-	-0.173	-0.214	-0.216

§ 6/27 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。
共通担保オペはノオベを予想する。

6/27 の予定(国内)

なし

6/27 の予定(海外)

米国 財の貿易収支(5月)
サービス業PMI速報(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	S6M	S1Y
◎ ノオベ	▲16,600	3,011,400	+3,011,400	-0.085	-0.060	-0.060	-0.060	-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)				*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
2016/6/28 ~ 2016/10/7	15,000	50	50	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
2016/6/27 ~ 2016/7/11	8,000	4,130	4,130	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
2016/6/20 ~ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	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
2016/6/13 ~ 2016/6/27	8,000	2,081	2,081	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
2016/6/6 ~ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/5/30 ~ 2016/6/13	8,000	2,500	2,500	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
2016/5/23 ~ 2016/6/6	8,000	5,591	5,591	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
2016/5/16 ~ 2016/5/30	8,000	2,830	2,830	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