

DAILY SIGNAL

平成28年6月27日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは224兆円。
本日の無担ON物は朝方▲0.03%の出し合いから始まり、
その後は▲0.08～▲0.03%で取引され、
引き続き動意の薄い地合いが終日続いた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,240,000	+2,240,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/27 のオペ結果
	6/27(月)		6/28(火)		6/29(水)		6/30(木)		
券	▲300		▲900		▲1,000		▲1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(6/29-) (残存5年超10年以下) ▲0.017%按分(18.0%) 4,503億 (物価連動債) ▲2.000%按分(59.3%) 253億 10:40 CP買入(6/30-) ▲0.002%按分(9.5%) 4,990億 11:50 国債補完供給(6/27-6/28) ▲0.600% 全取 471億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補完供給(6/27-6/28) ▲0.600% 全取 34億
財政	▲18,300		+2,400		+0		+1,000		
過不足	▲18,600		+1,500		▲1,000		+0		
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				+12,500		+4,800			
国庫短期証券買入				+15,000					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲2,100	+4,100	▲6,600	+100					
CP買現先									
CP等買入	▲800		▲500					+5,000	
社債等買入									
ETF買入				+300					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+600	▲500	+500						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲17,300		+22,800		+3,800		+5,000		
当座預金残高	3,010,700		3,033,500		3,037,300		3,042,300		
準備預金残高	2,721,600		2,241,700		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	2,241,700		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	2,241,700		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備先残高	289,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	99.8%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	40.0%		予想込増減 +22,800		予想込増減 +3,800		予想込増減 +5,000		
乖離率	59.8%		当預見込 3,033,500		当預見込 3,037,300		当預見込 3,042,300		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064.500
6/28以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4.200
6/28以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2.000

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.030	-0.100
レボ	-	-0.090
ビッド	-	0.000
出来値	-	-0.080

6/24 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,031,600

(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%

6/24 のコール市場残高(前日比)		
合計	67,790	-1,469
有担	20,258	-905
無担	47,532	-564

*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	-0.045	-	-	0.090	-	-	-	-	-	-
最高	-0.030	-0.030	-	-	0.110	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.061	-0.040	-	-	0.100	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.072	-0.078	-	-0.110	-0.111	-0.120	-0.127	-	-0.179	-0.214	-0.216

§ 6/28 オフア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。
共通担保オペはノオベを予想する。

6/28 の予定(国内)

8:50 5月の製造業部門別投入・産出物価指数(日銀)

6/28 の予定(海外)

米国 1-3月のGDP確報値
6月の消費者信頼感指数
ヘルキー EU首脳会議(29日まで)

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	+22,800	3,033,500	+3,033,500	-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				
2016/6/28 ~ 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	オフア額	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