

DAILY SIGNAL

平成28年6月30日(木)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

6/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは225兆4,000億円だった。
期末初となる本日の無担保コールON物は朝方▲0.05%の出合から始まった。
一巡後はビッドが薄くなり、▲0.08～▲0.03%で取引された。
後場に入っても地合いは変わらず引けた。

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

(単位:億円)

	日銀速報 6/30(木)		日銀予想 7/1(金)		当社需給予想				6/30 のオペ結果
	6/30(木)		7/1(金)		7/4(月)		7/5(火)		
券	▲500		▲900		+1,000		+1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲1,000		▲2,600		▲35,000		+5,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲1,500		▲3,500		▲34,000		+6,000		11:50 国債補完供給(6/30-7/1) ▲0.600% 全取 60億
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	12:50 ノーオペ
国債買入				+12,700					13:00 共通担保(全店)(固定金利) (7/4-7/19) 0% 全取 2,830億
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)			▲200	+100	▲4,200	+2,800	▲600		
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲6,900	+5,000							
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給		▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲3,500		+9,200		▲35,400		+5,400		
当座預金残高	3,032,800		3,042,000		3,006,600		3,012,000		
準備預金残高	2,725,900		2,725,900		2,725,900		2,725,900		
積み終了先	2,244,100		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +15,000		共通担保(本店) 0
超過準備	2,244,100								共通担保(全店) 9,871
非準備先残高	306,900								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	50.0%		予想込増減 +9,200		予想込増減 ▲35,400		予想込増減 +20,400		成長基盤強化 68,139
乖離率	49.9%		当預見込 3,042,000		当預見込 3,006,600		当預見込 3,027,000		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) 2,064,300
7/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,900
7/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.030	-	-0.100	-0.090
ビッド	-	-	0.000	-0.075
出来値	-	-	-	-

6/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,042,400

(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
6/30	617(3M)	-0.2905%	-0.2957%
6/23	616(3M)	-0.2224%	-0.2441%
6/15	615(3M)	-0.2517%	-0.2636%

6/29 のコール市場残高(前日比)		
合計	68,734	+1,945
有担	19,958	-996
無担	48,776	+2,941

*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	-0.086	-0.030	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.010	-0.020	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.064	-0.027	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.089	-0.092	-	-0.098	-0.101	-0.110	-0.118	-	-0.199	-0.217	-0.220

7/1 オペ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。

7/1 の予定(国内)

8:30 5月の完全失業率(総務省)
5月全国の消費者物価指数(総務省)
8:50 6月調査の短観概要(日銀)

7/1 の予定(海外)

米 6月の製造業PMI確報
6月のISM製造業指数

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
◎ ノーオペ	+9,200	3,042,000	+3,042,000	-0.085	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.070
				～	～	～	～	～	～	～	～
				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		
2016/7/4 ～ 2016/7/19	15,000	2,830	2,830	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		
2016/7/1 ～ 2016/10/11	15,000	70	70	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		
2016/6/28 ～ 2016/10/7	15,000	50	50	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		
2016/6/27 ～ 2016/7/11	8,000	4,130	4,130	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		
2016/6/20 ～ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	0.00%	固定金利	-	札割れ			米ドル資金供給オペ									
2016/6/13 ～ 2016/6/27	8,000	2,081	2,081	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		
2016/6/6 ～ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	0.00%	固定金利	-	札割れ			6/30 ～ 7/8	担保範囲内	1,475	1,475	0.870%	固定金利	-	1.00		
2016/5/30 ～ 2016/6/13	8,000	2,500	2,500	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		

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