

DAILY SIGNAL

平成28年6月29日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

6/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは226兆4,000億円。
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▲0.08～▲0.03%で取引された。
後場に入っても地合いに変化はなく引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,264,000	+2,264,000

(単位:億円)

	日銀速報 6/29(水)		日銀予想 6/30(木)		当社需給予想				6/29 のオペ結果
	7/1(金)	7/4(月)	7/1(金)	7/4(月)	7/1(金)	7/4(月)	7/1(金)	7/4(月)	
券	▲1,100	▲1,000	▲700	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000	9:20 ノーオペ
財政	+200	▲2,000	+0	▲2,000	▲2,000	▲2,000	▲2,000	▲2,000	10:10 国債買入(7/1-) (1年超3年以下)
過不足	▲900	▲3,000	▲700	▲3,000	▲3,000	▲3,000	▲3,000	▲3,000	(1年超5年以下)
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	+0.003%按分(41.3%) 3,508億 (3年超5年以下)
国債買入		+5,100				+11,500			+0.001%按分(59.9%) 4,402億 (残存10年超25年以下)
国庫短期証券買入									+0.013%按分(90.3%) 2,205億 (残存25年超)
国債買現先									+0.022%按分(88.9%) 1,404億
共通担保(本店)					▲200	+100	▲4,200		11:50 国債補完供給(6/29-6/30) ▲0.60%全取 12億
共通担保(全店)									12:50 ノーオペ
CP買現先	▲400		▲6,900	+5,000					13:00 共通担保(全店)(固定金利) (7/1-10/11) 0%全取 70億
CP等買入									
社債等買入									
ETF買入		+100							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援 貸出									
国債補完供給	+100								
成長基盤強化支援 貸出増加支援									
当座預金増減	+4,000	▲2,600	+4,000	▲2,600	+8,400	▲38,200			
当座預金残高	3,036,300	3,033,700	3,042,100	3,003,900					
準備預金残高	2,740,300								
積み終了先	2,267,200								
超過準備	2,267,200								
非準備先残高	296,000								
準備預金進捗率	99.8%								
平均	46.7%	予想込増減	▲2,600	予想込増減	+8,400	予想込増減	▲30,200		
乖離率	53.2%	当預見込	3,033,700	当預見込	3,042,100	当預見込	3,011,900		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,064.500
6/30以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,100
6/30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	
オフア	-0.030	-	-0.100	-0.100
ビッド	-	-	0.000	-0.075
出来値	-	-	-	-

6/28 時点のマナターベース(単位:億円) 4,037,200

(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%

6/28 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
6/28	66,789	-1,672	+2
6/27	20,954	-	-
6/26	45,835	-1,714	-

*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	-0.020	-	0.050	-0.040	-	-	-	-	-	-
最高	0.000	-0.010	-	0.117	-0.035	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.061	-0.019	-	0.084	-0.037	0.000	-0.030	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.105	-	-0.101	-0.104	-0.110	-0.123	-	-0.184	-0.214	-0.216

6/30 オフアのオペと市場動向予想

末初物となる明日の足許はビッドが薄く展開となろう。
共通担保オペは8,000億円のロールを予想する。

6/30 の予定(国内)

8:50 5月の鉱工業生産速報(経産省)
19:30 6月の当座預金増減要因と金融調節実績速報 (日銀)

6/30 の予定(海外)

米国 新規失業保険申請件数
英国 米ゼンロイス連銀総裁の講演(ロンドン)

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
◎	ノーオペ	▲2,600	3,033,700	+3,033,700	-0.085	-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				
2016/7/1 ~ 2016/10/11	15,000	70	70	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				
2016/6/28 ~ 2016/10/7	15,000	50	50	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				
2016/6/27 ~ 2016/7/11	8,000	4,130	4,130	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				
2016/6/20 ~ 2016/7/4	8,000	4,231	4,231	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				
2016/6/13 ~ 2016/6/27	8,000	2,081	2,081	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/6/6 ~ 2016/6/20	8,000	3,350	3,350	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				
2016/5/30 ~ 2016/6/13	8,000	2,500	2,500	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				
2016/5/23 ~ 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				

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