

DAILY SIGNAL

平成29年5月1日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 5/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは268兆9000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.08%の割合からスタート。
先週に引き続き調達意欲は限定的で、主に▲0.086%~▲0.07%の水準で取引された。
同加重平均金利は▲0.074%となり、先週末から横ばいであった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,689,000	2,689,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/1 のオペ結果
	5/1(月)		5/2(火)		5/8(月)		5/9(火)		
券	▲2,500		▲1,200		+4,000		+4,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(5/8-) (残存1年超3年以下) +0.001%按分(28.0%) 2,804億 (残存3年超5年以下) +0.002%按分(10.9%) 3,004億 (残存5年超10年以下) +0.001%按分(15.9%) 4,507億 (物価連動債) ▲0.09円按分(26.7%) 251億 11:50 国債補完供給(5/1-5/2) ▲0.600%全取 1,784億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)(固定金利) (5/8-5/22) 0%全取 1,740億 13:50 ノオベ
財政	▲9,100		▲8,100		▲34,000		+3,000		
過不足	▲11,600		▲9,300		▲30,000		+7,000		
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									
国庫短期証券買入				+5,000		+10,600			
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲2,700	+2,600			▲1,500	+1,700			
CP買現先									
CP等買入	▲300								
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	+2,400	▲1,800	+1,800						
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲11,400		▲2,500		▲19,200		+7,000		
当座預金残高	3,553,700		3,551,200		3,532,000		3,539,000		
準備預金残高	3,186,200								
積み終了先	2,688,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	2,688,300								
非準備預金残高	367,500								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	53.3%		予想込増減 ▲2,500		予想込増減 ▲19,200		予想込増減 +7,000		
乖離率	46.5%		当預見込 3,551,200		当預見込 3,532,000		当預見込 3,539,000		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,221.800
5/2以降の残り積み立て額(残り所要)積数 2,800
5/2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	-0.055	-	-0.100	-0.100
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

4/28 時点のマナターベース(単位:億円) 4,621,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	4/20
長期国債	282	361	382
CP等	2.2	2.3	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	13.4
J-REIT	0.27	0.36	0.39
貸出支援基金	31	41	46
国庫短期証券	43	50	39
その他とも資産計	383	476	493
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	355
その他とも負債・純資産計	383	476	493

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
5/1	680 (3M)	-0.1303%	-0.1395%
4/26	679 (3M)	-0.1383%	-0.1475%
4/20	678 (3M)	-0.1343%	-0.1427%

4/28 のコール市場残高(前日比)			
合計	81,143	-1,261	
有担	19,959	+1,160	
無担	61,184	-2,421	

*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	-	-	-0.055	-	-	-0.025	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	0.001	-	-	-	-
加重平均	-0.074	-0.045	-	-0.030	-0.040	-	-0.019	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.092	-0.095	-	-0.109	-0.110	-0.111	-0.115	-	-0.130	-0.182	-0.211

§ 5/2 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.086~+0.001%のレンジで取引されよう。
ノオベ予想。

5/2 の予定(国内)

8:50 4月のマナターベース(日銀)
3/15-16の日銀決定会合の議事録要旨(日銀) ユーロ圏 3月の失業率
10:00 4/30現在の営業毎旬報告(日銀)

5/2 の予定(海外)

米 FOMC(3日まで)

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	-2,500	3,551,200	+3,551,200	-0.086	-0.060	-0.060	-0.060	-0.050	-0.020	-0.020	-0.010	-0.010
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2017/5/8 ~ 2017/5/22	8,000	1,740	1,740	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/5/1 ~ 2017/5/15	8,000	2,550	2,550	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/4/24 ~ 2017/5/8	8,000	1,540	1,540	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/4/17 ~ 2017/5/1	8,000	2,650	2,650	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/4/10 ~ 2017/4/24	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/4/3 ~ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/3/27 ~ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	0.00%	固定金利	-	札割れ

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
4/27 ~ 5/11	担保範囲内	0	0	1.360%	固定金利	0.0%	応れなし
4/20 ~ 4/27	担保範囲内	0	0	1.410%	固定金利	0.0%	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