

DAILY SIGNAL

平成29年5月8日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 5/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは267兆1000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.065%の出合からスタートし、その後は▲0.08～▲0.055%のレンジで取引された。先週と比較して資金調達意欲はやや強く、加重平均金利は▲0.065%に上昇した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,671,000	2,671,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/8 のオペ結果
	5/8(月)		5/9(火)		5/10(水)		5/11(木)		
券	+4,700		+4,000		+3,000		+3,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(5/10-) (残存1年以下) +0.041%按分(62.0%) 700億 (残存10年超25年以下) +0.008%按分(54.3%) 2,011億 (残存25年超) +0.008%按分(90.1%) 1,007億 11:50 国債補完供給(5/8-5/9) ▲0.600% 全取 2,466億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲46,800		+5,200		+4,000		▲28,000		
過不足	▲42,100		+9,200		+7,000		▲25,000		
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		+10,700				+3,700			
国庫短期証券買入				+5,000					
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲1,500	+1,700							
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲600						
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	+1,800	▲2,500	+2,500						
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	▲32,100		+16,100		+10,700		▲25,000		
当座預金残高	3,517,600		3,533,700		3,544,400		3,519,400		
準備預金残高	3,175,500								
積み終了先			ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	2,673,400								
非準備先残高	342,100								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	76.7%		予想込増減 +16,100		予想込増減 +10,700		予想込増減 ▲25,000		
乖離率	23.2%		当預見込 3,533,700		当預見込 3,544,400		当預見込 3,519,400		
							共通担保(全店) 4,680		
							国債買現先 0		
							CP買現先 0		
							成長基盤強化 81,054		
							被災地金融機関支援 5,254		
							ロンハート残高 0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,221.800
5/9以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,100
5/9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	-0.040	-	-0.100	-0.095
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.080
出来値	-	-	-	-

5/2 時点のマナターベース(単位:億円) 4,609,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	4/30
長期国債	282	361	385
CP等	2.2	2.3	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	13.7
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	498
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	357
その他とも負債・純資産計	383	476	498

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%

5/2 のコール市場残高(前日比)			
	合計	平均	増減
有担	88,998		+837
無担	22,874		+2,900
無担	66,124		-2,063

*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	-	-	-0.050	-0.040	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.040	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.065	-0.001	-	-0.046	-0.025	-0.030	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.082	-0.077	-	-0.091	-0.096	-0.101	-0.105	-	-0.127	-0.182	-0.211

§ 5/9 オファタ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。
共通担保オペはノオベ予想。

5/9 の予定(国内)

9:00 3月の毎月勤労統計速報(厚労省)

5/9 の予定(海外)

米 ホスト連銀総裁の講演

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	+16,100	3,533,700	+3,533,700	-0.086	-0.050	-0.050	-0.050	-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)

*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	按分レド	平均レド	倍率	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	-	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ
2017/5/1 ~ 2017/5/15	8,000	2,550	2,550	0.00%	固定金利	-	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2017/4/24 ~ 2017/5/8	8,000	1,540	1,540	0.00%	固定金利	-	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2017/4/17 ~ 2017/5/1	8,000	2,650	2,650	0.00%	固定金利	-	米ドル資金供給オペ							
2017/4/10 ~ 2017/4/24	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	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
2017/4/3 ~ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	0.00%	固定金利	-	4/27 ~ 5/11	担保範囲内	0	0	1.360%	固定金利	0.0%	応れなし
2017/3/27 ~ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	0.00%	固定金利	-	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。投資については最終決定は、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