

DAILY SIGNAL

平成29年5月9日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 5/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは267兆4000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.06%の出合から始まり、その後は▲0.065~▲0.045%のレンジで取引される堅調な地合となった。調達一巡後も出合水準は変わらず、後場に入って▲0.06%近辺で調整程度の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,674,000	2,674,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/9 のオペ結果
	5/9(火)		5/10(水)		5/11(木)		5/12(金)		
券	+3,900		+3,400		+3,000		+2,000		9:20 ノオベ 10:40 米ドル資金供給(5/11-5/18) 貸付利率1.410% 1百万米ドル CP等買入(5/12-) ▲0.005%按分(98.9%) 2,495億 11:50 国債補完供給(5/9-5/10) ▲0.600% 全取 1,480億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+3,800		▲600		▲28,000		▲21,000		
過不足	+7,700		+2,800		▲25,000		▲19,000		
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				+3,900					
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)									
CP買現先	▲600		▲600					+2,500	
CP等買入									
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	+2,500	▲1,500	+1,500						
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	+13,100		+7,600		▲25,000		▲16,500		
当座預金残高	3,530,700		3,538,300		3,513,300		3,496,800		
準備預金残高	3,163,500								
積み終了先	2,661,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	2,661,100								
非準備預金残高	367,200								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	80.0%		予想込増減 +7,600		予想込増減 ▲25,000		予想込増減 ▲16,500		
乖離率	19.9%		当預見込 3,538,300		当預見込 3,513,300		当預見込 3,496,800		
								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	
								ロンバート残高 0	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,240,700
5/10以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 900
5/10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	-0.130
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

5/8 時点のマナタリーベース(単位:億円) 4,573,100

(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%

5/8 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	89,304	+306	
	22,684	-190	
	66,620	+496	

*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	-0.075	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	-	-	-0.040	-	-	0.005	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.090	-0.122	-	-0.103	-0.104	-0.107	-0.110	-	-0.130	-0.180	-0.209

§ 5/10 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.075~+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。

5/10 の予定(国内)

8:50 4月の金融政策決定会合における
主な意見(日銀)
14:00 3月の景気動向指数速報(内閣府)

5/10 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
4月の輸入物価指数

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	S1Y
◎ ノオベ	+7,600	3,538,300	+3,538,300	-0.075	-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)

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
5/11 ~ 5/18	担保範囲内	1	1	1.410%	固定金利	0.0%	1.00
4/27 ~ 5/11	担保範囲内	0	0	1.360%	固定金利	0.0%	応札なし

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