

DAILY SIGNAL

5/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは265兆8000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.045%の出合から始まり、
その後は▲0.05～▲0.03%のレンジで取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06%の出合が散見された。

平成29年5月10日(水)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,658,000	2,658,000

(単位:億円)

		日銀速報 5/10(水)		日銀予想 5/11(木)		当社需給予想 5/12(金) 5/15(月)				5/10 のオペ結果	
						5/12(金)		5/15(月)		9:20 ノーオペ	
券		+3,500		+1,600		+2,000		+2,000		10:10 国債買入(5/12-)	
財政		+100		▲26,300		▲21,000		▲34,000		(残存1年超3年以下)	
過不足		+3,600		▲24,700		▲19,000		▲32,000		(残存3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	(残存5年超10年以下)	
国債買入			+3,900			+10,300				+0.005% 按分(80.0%) 2,807億	
国庫短期証券買入										(残存3年超5年以下)	
国債買現先										+0.006% 按分(22.8%) 3,004億	
国債売現先										(残存5年超10年以下)	
共通担保(本店)										+0.002% 按分(10.9%) 4,514億	
共通担保(全店)								▲2,600		11:50	
CP買現先		▲600		▲500		+2,500				国債補完供給(5/10-5/11)	
CP等買入										▲0.600% 全取 821億	
社債等買入										12:50	
ETF買入										ノーオペ	
J-REIT買入										13:00	
被災地金融機関支援										ノーオペ	
貸出											
国債補完供給		+1,500	▲800	+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		+7,600		▲24,400		▲6,200		▲34,600			
当座預金残高		3,538,300		3,513,900		3,507,700		3,473,100			
準備預金残高		3,164,700								共通担保オペ当社予想	
積み終了先		2,661,600		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 4,680	
超過準備		2,661,600								国債買現先 0	
非準備先残高		373,600								CP買現先 0	
準備預金進捗率		99.9%								成長基盤強化 81,054	
平均		83.3%		予想込増減 ▲24,400		予想込増減 ▲6,200		予想込増減 ▲26,600		被災地金融機関支援 5,254	
乖離率		16.6%		当預見込 3,513,900		当預見込 3,507,700		当預見込 3,481,100		ロンバード残高	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,240,700
5/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 800
5/11 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	-0.105
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

5/9 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,582,200

(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
5/10	681 (6M)	-0.1302%	-0.1382%
5/1	680 (3M)	-0.1303%	-0.1395%
4/26	679 (3M)	-0.1383%	-0.1475%

5/9 のコール市場残高(前日比)			
合計	88,546	-758	
有担	20,895	-1,789	
無担	67,651	+1,031	

*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	-0.065	-	-	-	-0.030	-	-0.040	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.000	-	-0.030	-	-	-	-
加重平均	-0.042	-0.001	-	-0.030	-0.020	-	-0.033	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.107	-0.095	-	-0.104	-0.106	-0.108	-0.110	-	-0.129	-0.180	-0.209

5/11 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.065～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

5/11 の予定(国内)

8:50 3月の国際収支(財務省)
14:00 4月の景気ウオッチャー調査(内閣府)

5/11 の予定(海外)

米 4月の生産者物価指数
週間の新規失業保険申請件数

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			
◎ ノーオペ	▲24,400	3,513,900	+3,513,900	-0.065	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-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
2017/5/8 ～ 2017/5/22	8,000	1,740	1,740	0.00%	固定金利	－	札割れ	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	－	札割れ	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	－	札割れ	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	－	札割れ	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	－	札割れ	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	－	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
2017/4/3 ～ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	0.00%	固定金利	－	札割れ	5/11 ～ 5/18	担保範囲内	1	1	1.410%	固定金利	0.0%	1.00
2017/3/27 ～ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	0.00%	固定金利	－	札割れ	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