

DAILY SIGNAL

平成29年5月11日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 5/11 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは265兆1000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.04%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る堅調な地合となった。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	-	-	2,651,000	2,651,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/11 のオペ結果
	5/11(木)		5/12(金)		5/15(月)		5/16(火)		
券		+1,700		+1,200		+2,000		+1,000	9:20 ノオベ
財政		▲25,800		▲20,300		▲34,000		+5,000	10:10 ノオベ
過不足		▲24,100		▲19,100		▲32,000		+6,000	11:50 ノオベ
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	11:50 国債補完供給(5/11-5/12) ▲0.500% 全取 771億
国債買入				+10,500					12:50 ノオベ
国庫短期証券買入									13:00 ノオベ
国債買現先						▲2,600	+2,600		共通担保(全店)<固定金利> (5/15-5/29) 0% 全取 2,601億
国債売現先									13:50 ノオベ
共通担保(本店)									13:50 ノオベ
共通担保(全店)									国債補完供給(5/11-5/12) ▲0.500% 全取 50億
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲300	+2,500					
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	+800	▲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		▲24,600		▲5,600		▲32,000		+6,000	
当座預金残高		3,513,700		3,508,100		3,476,100		3,482,100	
準備預金残高		3,157,800							
積み終了先		2,653,300							
超過準備		2,653,300							
非準備預金残高		355,900							
準備預金進捗率		99.9%							
平均		86.7%	予想込増減	▲5,600	予想込増減	▲32,000	予想込増減	+6,000	
乖離率		13.2%	当預見込	3,508,100	当預見込	3,476,100	当預見込	3,482,100	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,240,700
5/12以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 500
5/12以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	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	-0.085
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.075
出来値	-	-	-	-

5/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,586,400**

(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
5/11	682 (3M)	-0.1243%	-0.1327%
5/10	681 (6M)	-0.1302%	-0.1382%
5/1	680 (3M)	-0.1303%	-0.1395%

5/10 のコール市場残高(前日比)		
合計	91,572	+3,026
有担	18,278	-2,617
無担	73,294	+5,643

*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	-0.070	-0.035	-	-0.043	-0.035	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.001	-	-0.015	-0.030	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.039	-0.022	-	-0.029	-0.031	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.097	-0.093	-	-0.101	-0.103	-0.107	-0.109	-	-0.129	-0.179	-0.209

§ 5/12 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.07~+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。

5/12 の予定(国内)

8:50 4月のマネーストック(日銀)
10:00 5月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

5/12 の予定(海外)

米 4月のCPI
4月の小売売上高
5月のシカゴ大学消費者信頼感速報

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	▲5,600	3,508,100	+3,508,100	-0.070	-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)

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
2017/5/15 ~ 2017/5/29	8,000	2,601	2,601	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

*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