

DAILY SIGNAL

平成29年5月15日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 5/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは262兆6000億円だった。
積み最終日となる本日の無担保コールON物は▲0.035%の割合から始まった。
その後は▲0.045%～▲0.02%のレンジで取引された。
後場では▲0.025%で調整程度の割合が散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	2,626,000	2,626,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/15 のオペ結果
	5/15(月)		5/16(火)		5/17(水)		5/18(木)		
券	+1,900		+1,400		+1,000		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲32,500		+2,700		+4,000		▲22,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲30,600		+4,100		+5,000		▲22,000		11:50 国債補完供給(5/15-5/16) ▲0.500% 全取 406億
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	12:50 ノーオペ
国債買入				+7,500					13:00 ノーオペ
国庫短期証券買入				+10,000					13:50 国債補完供給(5/15-5/16) ▲0.500% 全取 364億
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲2,600	+2,600							
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲100						
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	+900	▲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	▲30,900		+22,300		+5,000		▲22,000		
当座預金残高	3,475,900		3,498,200		3,503,200		3,481,200		
準備預金残高	3,141,600								
積み終了先	2,628,500								共通担保オペ当社予想
超過準備	2,628,500								ノーオペ
非準備先残高	334,300								ノーオペ
準備預金進捗率	100.0%								ノーオペ
平均	100.0%		予想込増減	+22,300	予想込増減	+5,000	予想込増減	▲22,000	共通担保(全店) 4,731
乖離率	0.0%		当預見込	3,498,200	当預見込	3,503,200	当預見込	3,481,200	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

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,989,500
5/16以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,989,500
5/16以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 96,400

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.025	-	-0.100	-0.100
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

5/12 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,551,700**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	5/10
長期国債	282	361	387
CP等	2.2	2.3	2.3
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	100
当座預金	253	330	354
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%

5/12 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	96,845	+4,910	
	21,290	+780	
	75,555	+4,130	

*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	-	-	-0.050	-0.045	-	-	-	-	-	-
最高	0.020	-	-	0.001	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.033	0.000	-	-0.025	-0.035	-	-	-	0.000	-	-
東京レボ・レート	-0.072	-0.093	-	-0.096	-0.097	-0.104	-0.106	-	-0.129	-0.178	-0.207

§ 5/16 オファーのオペと市場動向予想

積み初日は▲0.08～+0.01%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノーオペ予想。

5/16 の予定(国内)

13:30 3月の第3次産業活動(経産省)
17:00 4月の業態別の日銀当座預金残高(日銀)

5/16 の予定(海外)

米 4月の住宅着工件数
4月の鉱工業生産
欧 1～3月のGDP(1次速報値の詳細)

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	+22,300	3,498,200	+3,498,200	-0.080	-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