

# DAILY SIGNAL

平成29年5月16日(火)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 5/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは313兆3000億円だった。  
新積み初日となる本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まった。  
その後は▲0.065%～▲0.03%のレンジで取引された。  
後場では▲0.07%で調整程度の出合が見られて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,133,000	3,133,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/16 のオペ結果
	5/16(火)		5/17(水)		5/18(木)		5/19(金)		
券	+1,400		+600		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	+2,300		+8,100		▲22,000		+3,000		10:10 ノーオペ
過不足	+3,700		+8,700		▲22,000		+3,000		10:40 米ドル資金供給(5/18-5/25) 貸付利率 1.410% 1百万米ドル
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 国債補充供給(5/16-5/17) ▲0.500% 全取 583億
国債買入		+7,500							12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入		+10,000							13:00 ノーオペ
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									
CP等買入	▲100		▲100						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補充供給	+800	▲600	+600						
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	+21,300		+9,200		▲22,000		+3,000		
当座預金残高	3,497,200		3,506,400		3,484,400		3,487,400		
準備預金残高	3,119,300								
積み終了先	986,300		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 4,731
超過準備	750,300								国債買現先 0
非準備預金残高	377,900								CP買現先 0
準備預金進捗率	79.2%								成長基盤強化 81,054
平均	3.2%		予想込増減 +9,200		予想込増減 ▲22,000		予想込増減 +3,000		被災地金融機関支援 5,254
乖離率	76.0%		当預見込 3,506,400		当預見込 3,484,400		当預見込 3,487,400		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,989.500  
5/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 620.600  
5/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 20.700

	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
ビッド	-0.060	-0.090
出来値	-	-

5/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,518,800**

(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%

## 5/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	92,190	22,801	-4,655
		22,801	+1,511
		69,389	-6,166

\*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	-	-	-	-0.035	-	-	-0.005	-	-	-
最高	0.010	-	-	-	-0.008	-	-	0.040	-	-	-
加重平均	-0.048	-	-	-0.030	-0.028	-	-0.035	0.018	-	-	-
東京レボ・レート	-0.092	-0.095	-	-0.097	-0.101	-0.104	-0.107	-	-0.129	-0.178	-0.207

## § 5/17 オファーのオペと市場動向予想

無担保コールON物は▲0.08～+0.001%のレンジで取引されよう。共通担保オペはノーオペ予想。

## 5/17 の予定(国内)

8:50 3月の機械受注(内閣府)  
13:00 3月の鉱工業生産確報(経産省)

## 5/17 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数  
欧 4月のCPI確報

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
◎ ノーオペ	+9,200	3,506,400	+3,506,400	-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	按分レート	平均レート	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	按分レート	平均レート	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率
5/18 ~ 5/25	担保範囲内	1	1	1.410%	固定金利	0.0%	1.00
5/11 ~ 5/18	担保範囲内	1	1	1.410%	固定金利	0.0%	1.00

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