

DAILY SIGNAL

平成29年5月23日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 5/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは311兆7000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.045%の出合から始まった。
その後は主に▲0.08%～▲0.03%の水準で取引された。
調達一巡後は、ビッドが薄くなり調整程度の出合が散見され引けた。
また、一部で試取の動きが見られ、同加重平均金利は▲0.037%と前日対比+0.014%となった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,117,000	3,117,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/23 のオペ結果
	5/23(火)		5/24(水)		5/25(木)		5/26(金)		
券	▲200		▲900		▲1,000		▲1,000		9:20 ノーオペ
財政	+1,800		▲1,500		▲5,000		+14,000		10:10 ノーオペ
過不足	+1,600		▲2,400		▲6,000		+13,000		10:40 米ドル資金供給(5/25-6/2) 貸付利率 1.410% 0百万米ドル
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 国債補完供給(5/23-5/24) ▲0.600% 全取 108億
国債買入		+4,100		+6,100					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		▲400						
社債等買入									
ETF買入				+200					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+500	▲100	+100						
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	+16,000		+3,600		▲6,000		+14,000		
当座預金残高	3,486,300		3,489,900		3,483,900		3,497,900		
準備預金残高	3,111,900		3,111,900		3,111,900		3,111,900		
積み終了先			ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 4,831
超過準備	3,108,600		3,108,600		3,108,600		3,108,600		国債買現先 0
非準備預金残高	374,400		374,400		374,400		374,400		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.5%		99.5%		99.5%		99.5%		成長基盤強化 81,054
平均	22.6%		22.6%		22.6%		22.6%		被災地金融機関支援 5,254
乖離率	76.9%		76.9%		76.9%		76.9%		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,989.500
5/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 15,300
5/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 700

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.020	-0.100
レボG.C	-0.090	-0.075
ビッド	-0.050	0.000
出来値	-	-

5/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,510,500**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	5/20
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	38
その他とも資産計	383	476	498
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	349
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
5/18	684 (3M)	-0.1243%	-0.1287%
5/17	683 (1Y)	-0.1461%	-0.1561%
5/11	682 (3M)	-0.1243%	-0.1327%

5/22 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
90,257	-1,250	20,719	-529
69,538	-721		

*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	-0.086	-	-	-0.038	-0.045	-0.025	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	0.000	0.000	-	-	-	-	-
加重平均	-0.037	-0.001	-	-0.031	-0.039	-0.021	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.086	-0.08	-	-0.096	-0.099	-0.101	-0.104	-	-0.126	-0.176	-0.205

§ 5/24 オファーのオペと市場動向予想

無担保コールON物は▲0.086～+0.001%のレンジで取引されよう。共通担保オペはノーオペを予想。

5/24 の予定(国内)

黒田総裁、挨拶
日銀主催「金融政策: 教訓と課題」
バーナンキ前FRB総裁講演(同カンファレンス)

5/24 の予定(海外)

米 中古住宅販売件数(4月)
FOMC議事録(5/2-3両日分)
ドラギ 総裁講演

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	+3,600	3,489,900	+3,489,900	-0.086	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.020	-0.010	-0.010
					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
2017/5/22 ~ 2017/6/5	8,000	1,840	1,840	0.00%	固定金利	-	札割れ
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
2017/4/17 ~ 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

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
5/25 ~ 6/2	担保範囲内	0	0	1.410%	固定金利	0.0%	応れなし
5/18 ~ 5/25	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