

DAILY SIGNAL

平成29年5月31日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/31 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは315兆1000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.078%の出合からスタート。
その後は▲0.086～▲0.045%の出合が見られた。
同加重平均金利は▲0.065%と昨日から0.4bp低下した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,151,000	3,151,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/31 のオペ結果
	5/31(水)		6/1(木)		6/2(金)		6/5(月)		
券	+200		+0		+0		+1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲600		▲12,900		▲40,000		▲1,000		10:10 国債買入(6/2-)
過不足	▲400		▲12,900		▲40,000		+0		(残存1年超3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3年超5年以下)
国債買入									+0.006% 按分(74.7%) 2,801億
国庫短期証券買入									(残存10年超25年以下)
国債買現先									+0.003% 按分(10.6%) 2,019億
国債売現先									(残存25年超)
共通担保(本店)									+0.002% 按分(80%) 1,003億
共通担保(全店)									10:40
CP買現先	▲1,000	+2,500	▲200				▲1,800		米ドル資金供給(6/2-6/8)
CP等買入									貸付利率 1.410% 0百万米ドル
社債等買入									11:50
ETF買入		+900	+100						国債補完供給(5/31-6/1)
J-REIT買入									▲0.600% 全取 543億
被災地金融機関支援									12:50
貸出									ノーオペ
国債補完供給	+300	▲600	+600						13:00
米ドル供給用担保国債供給					▲800	+8,600			ノーオペ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+1,700		▲12,400		▲23,400		▲1,800		
当座預金残高	3,516,900		3,504,500		3,481,100		3,479,300		
準備預金残高	3,147,000								
積み終了先	3,146,500								共通担保オベ当社予想
超過準備	3,146,400								ノーオペ
非準備先残高	369,900								共通担保(全店) +8,000
準備預金進捗率	99.9%								共通担保(全店) 4,910
平均	51.6%		予想込増減 ▲12,400		予想込増減 ▲23,400		予想込増減 +6,200		国債買現先 0
乖離率	48.2%		当預見込 3,504,500		当預見込 3,481,100		当預見込 3,487,300		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

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,990,400
6/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,100
6/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	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
レボ	-0.070	-0.065
ビッド	-0.070	0.000
出来値	-	-

5/30 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,557,800

(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
5/25	685 (3M)	-0.1182%	-0.1206%
5/18	684 (3M)	-0.1243%	-0.1287%
5/17	683 (1Y)	-0.1461%	-0.1561%

5/30 のコール市場残高(前日比)		
合計	93,043	+93,043
有担	21,642	+21,642
無担	71,401	+71,401

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.065	-0.010	-	-0.030	-0.018	-0.005	-0.050	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.078	-0.073	-	-0.085	-0.087	-0.094	-0.121	-	-0.119	-0.166	-0.198

5/31 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.086～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オベは期落ち分がロールオファーされると予想。

6/1 の予定(国内)

8:50 1-3月の法人企業統計(財務省)
16:00 5月の債券市場サーベイ(日銀)
原田日銀審議委員会見(岐阜市)

6/1 の予定(海外)

米 5月のADP雇用統計
週間の新規失業保険申請件数
5月のISM製造業指数

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	▲12,400	3,504,500	+3,504,500	-0.086	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.020	-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
2017/5/29 ~ 2017/6/12	8,000	2,680	2,680	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

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
2017/5/24 ~ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	札割れ
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

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
6/2 ~ 6/8	担保範囲内	0	0	1.410%	固定金利	0.0%	応れなし
5/25 ~ 6/2	担保範囲内	0	0	1.410%	固定金利	0.0%	応れなし

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