

# DAILY SIGNAL

平成29年6月5日(月)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 6/5 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは313兆1,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は▲0.06%の出合からスタートし、  
その後は概ね▲0.08～▲0.045%のレンジで出合が見られた。  
また、先週末に引き続きビッドが薄く、一部▲0.08%台半ばの出合も見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,131,000	3,131,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/5 のオペ結果
	6/5(月)		6/6(火)		6/7(水)		6/8(木)		
券	+1,200		+1,200		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	+3,600		+3,100		+1,000		+0		10:10 ノーオペ
過不足	+4,800		+4,300		+1,000		+0		11:50 国債補完供給(6/5-6/6) ▲0.600% 全取 180億
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				+11,500					13:00 ノーオペ
国庫短期証券買入				+5,000					13:50 国債補完供給(6/5-6/6) ▲0.600% 全取 1億
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲1,800	+2,000							
CP買現先									
CP等買入	▲900		▲800						
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	+100	▲200	+200						
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援	▲100								
貸出増加支援									
当座預金増減	+3,900		+20,200		+1,000		+0		
当座預金残高	3,472,900		3,493,100		3,494,100		3,494,100		
準備預金残高	3,132,100								
積み終了先	3,131,900		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 5,020
超過準備	3,131,900								国債買現先 0
非準備預金残高	340,800								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化 88,941
平均	67.7%		予想込増減	+20,200	予想込増減	+1,000	予想込増減	+0	被災地金融機関支援 5,254
乖離率	32.2%		当預見込	3,493,100	当預見込	3,494,100	当預見込	3,494,100	ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,990,400  
6/6 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 1,400  
6/6 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	-0.040	-0.100
レボ	-0.070	-0.070
ビッド	-0.070	0.000
出来値	-	-

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	5/31
長期国債	282	361	390
CP等	2.2	2.3	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	14.0
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	37
その他とも資産計	383	476	501
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	352
その他とも負債・純資産計	383	476	501

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
6/1	686 (3M)	-0.1162%	-0.1218%
5/25	685 (3M)	-0.1182%	-0.1206%
5/18	684 (3M)	-0.1243%	-0.1287%

6/2 のコール市場残高(前日比)			
合計	87,831	+1,478	
有担	22,097	-358	
無担	65,734	+1,836	

\*出所: 営業毎旬報告  
\*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

6/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,511,400

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	-0.001	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.001	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.058	0.000	-	-0.043	-	-0.035	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.074	-0.072	-	-0.079	-0.081	-0.089	-0.113	-	-0.116	-0.161	-0.196

## § 6/6 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。  
共通担保オペはノーオペを予想。

## 6/6 の予定(国内)

8:50 4月の毎月勤労統計速報

## 6/6 の予定(海外)

欧 4月の小売売上高

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	+20,200	3,493,100	+3,493,100	-0.086	-0.050	-0.050	-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

共通担保資金供給(全店)

\*当日物

共通担保資金供給(本店)

\*当日物

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	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
2017/6/5 ~ 2017/6/19	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	-	札割れ	2017/5/24 ~ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	札割れ
2017/5/29 ~ 2017/6/12	8,000	2,680	2,680	0.00%	固定金利	-	札割れ	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ
2017/5/22 ~ 2017/6/5	8,000	1,840	1,840	0.00%	固定金利	-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2017/5/15 ~ 2017/5/29	8,000	2,601	2,601	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2017/5/8 ~ 2017/5/22	8,000	1,740	1,740	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2017/5/1 ~ 2017/5/15	8,000	2,550	2,550	0.00%	固定金利	-	札割れ	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
2017/4/24 ~ 2017/5/8	8,000	1,540	1,540	0.00%	固定金利	-	札割れ	6/2 ~ 6/8	担保範囲内	0	0	1.410%	固定金利	0.0%	応れなし
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ	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