

# DAILY SIGNAL

平成29年6月7日(水)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 6/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは315兆2,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は▲0.055%の出合からスタートし、その後は▲0.086~▲0.04%のレンジで取引が見られた。調達一巡後は▲0.08%台の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,152,000	3,152,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/7 のオペ結果
	6/7(水)		6/8(木)		6/9(金)		6/12(月)		
券		+300		▲200		▲1,000		+1,000	9:20 ノーオペ
財政		+4,000		+1,500		+2,000		+8,000	10:10 国債買入(6/9-)
過不足		+4,300		+1,300		+1,000		+7,000	(残存5年超10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	▲0.006% 按分(68.5%) 4,505億
国債買入						+7,800			(残存10年超25年以下)
国庫短期証券買入									▲0.007% 按分(94.0%) 2,017億
国債買現先									(残存25年超)
国債売現先									▲0.004% 按分(60.4%) 1,003億
共通担保(本店)									(物価連動債)
共通担保(全店)									▲0.280円 按分(6.7%) 250億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲200		▲300			+3,500			国債補完供給(6/7-6/8)
社債等買入									▲0.600% 全取 51億
ETF買入									12:50
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									13:00
貸出									ノーオペ
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		+4,500	+1,100		+12,300			▲9,900	
当座預金残高		3,496,800	3,497,900		3,510,200			3,500,300	
準備預金残高		3,152,600							
積み終了先		3,152,500							
超過準備		3,152,500							
非準備先残高		344,200							
準備預金進捗率		99.9%							
平均		74.2%	予想込増減	+1,100	予想込増減	+12,300	予想込増減	+3,100	
乖離率		25.7%	当預見込	3,497,900	当預見込	3,510,200	当預見込	3,513,300	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,998,100  
6/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,200  
6/8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	-
レボ	-0.100	-0.080
ビッド	-0.080	-
レボ	0.000	-0.060
出来値	-	-

6/6 時点のマナタリーベース(単位:億円) 4,532,300

(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
6/7	687 (6M)	-0.0982%	-0.1042%
6/1	686 (3M)	-0.1162%	-0.1218%
5/25	685 (3M)	-0.1182%	-0.1206%

6/6 のコール市場残高(前日比)		
合計	97,872	+2,760
有担	22,437	+484
無担	75,435	+2,276

\*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	-	-	-	-	-0.040	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-0.035	-	-	-	-	-
加重平均	-0.056	-	0.001	-0.035	0.000	-0.038	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.072	-0.070	-	-0.077	-0.080	-0.089	-0.104	-	-0.108	-0.154	-0.193

## § 6/8 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。  
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

## 6/8 の予定(国内)

8:50 1~3月のGDP改定値(内閣府)  
5月の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

## 6/8 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数  
欧 ECB理事会、ECB総裁の会見

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	当残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	+1,100	3,497,900	+3,497,900	-0.086	-0.050	-0.050	-0.030	-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
2017/6/5 ~ 2017/6/19	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	-	札割れ
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
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	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
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
6/8 ~ 6/15	担保範囲内	1	1	1.410%	固定金利	0.0%	1.00
6/2 ~ 6/8	担保範囲内	0	0	1.410%	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