

DAILY SIGNAL

§ 6/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは316兆1,000億円だった。
 本日の無担保コールON物は▲0.055%の出合から始まり、その後は
 ▲0.075～▲0.04%のレンジで取引された。後場に入っても水準は変わらず、
 調整程度の出合が散見されて引けた。

平成29年6月13日(火)
 上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,161,000	3,161,000

(単位:億円)

	日銀速報 6/13(火)		日銀予想 6/14(水)		当社需給予想				6/13 のオペ結果
	6/13(火)		6/14(水)		6/15(木)		6/16(金)		
券	▲100		+0		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ
財政	+3,100		▲1,200		+47,000		+1,000		10:10 ノーオペ
過不足	+3,000		▲1,200		+47,000		+0		10:40 ノーオペ
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	10:40 米ドル資金供給(6/15-6/22) 貸付利率 1.640% 2百万米ドル
国債買入		+9,200							11:50 国債補完供給(6/13-6/14) ▲0.600% 全取 60億
国庫短期証券買入		+7,500							
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	▲600		▲500						
社債等買入	▲400								
ETF買入		+100							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援			▲900	+900					
貸出									
国債補完供給	+100	▲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	+18,800		▲1,600		+47,000		+0		
当座預金残高	3,515,000		3,513,400		3,560,400		3,560,400		
準備預金残高	3,155,400		3,155,100		3,155,100		3,155,100		
積み終了先	3,155,100		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 4,920
超過準備	3,155,100								国債買現先 0
非準備預金残高	359,600								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化 88,941
平均	93.5%		予想込増減 ▲1,600		予想込増減 +47,000		予想込増減 +0		被災地金融機関支援 5,254
乖離率	6.4%		当預見込 3,513,400		当預見込 3,560,400		当預見込 3,560,400		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,998,100
 6/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
 6/14 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	-0.100
ビッド	-0.070	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

6/12 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,535,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	6/10
長期国債	282	361	393
CP等	2.2	2.3	2.5
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	14.1
J-REIT	0.27	0.36	0.40
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	505
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	351
その他とも負債・純資産計	383	476	505

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
6/8	688 (3M)	-0.0922%	-0.0970%
6/7	687 (6M)	-0.0982%	-0.1042%
6/1	686 (3M)	-0.1162%	-0.1218%

6/12 のコール市場残高(前日比)		
合計	91,288	+2,146
有担	21,919	+126
無担	69,369	+2,020

*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	-0.054	0.005	-	-0.035	-0.050	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.083	-0.095	-	-0.087	-0.087	-0.101	-0.101	-	-0.104	-0.137	-0.184

§ 6/14 オファタ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。

6/14 の予定(国内)

なし

6/14 の予定(海外)

米 FOMCの結果
 FRB議長の会見
 5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	S1Y
◎ ノーオペ	▲1,600	3,513,400	+3,513,400	-0.086	-0.050	-0.050	-0.020	-0.020	-0.020	-0.020	-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)			
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	期間	オファー額	応札額	落札額
2017/6/12 ～ 2017/6/26	8,000	2,580	2,580	0.00%	固定金利	-	札割れ	2017/5/24 ～ 2017/5/25	1,000	28	28
2017/6/12 ～ 2017/6/19	5,000	170	170	0.00%	固定金利	-	札割れ	2016/10/20 ～ 2016/10/21	1,000	22	22
2017/6/5 ～ 2017/6/19	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	-	札割れ	2015/11/18 ～ 2015/11/19	1,000	19	19
2017/5/29 ～ 2017/6/12	8,000	2,680	2,680	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/5 ～ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002
2017/5/22 ～ 2017/6/5	8,000	1,840	1,840	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ			
2017/5/15 ～ 2017/5/29	8,000	2,601	2,601	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額
2017/5/8 ～ 2017/5/22	8,000	1,740	1,740	0.00%	固定金利	-	札割れ	6/15 ～ 6/22	担保範囲内	2	2
2017/5/1 ～ 2017/5/15	8,000	2,550	2,550	0.00%	固定金利	-	札割れ	6/8 ～ 6/15	担保範囲内	1	1
									平均レート	按分率	倍率
									1.640%	固定金利	0.0%
									1.410%	固定金利	0.0%

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