

# DAILY SIGNAL

平成29年6月14日(水)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 6/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは315兆8,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まった。  
その後は▲0.08～▲0.04%のレンジで取引された。  
後場ではビッドが薄くなり、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	-	-	3,158,000	3,158,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/14 のオペ結果
	6/14(水)		6/15(木)		6/16(金)		6/19(月)		
券	+0		▲900		▲1,000		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(6/16-) (残存5年超10年以下) ▲0.003% 按分(88.3%) 4,507 億 (残存10年超25年以下) ▲0.005% 按分(26.2%) 2,009 億 (残存25年超) ▲0.008% 按分(88.4%) 1,008 億 10:40 CP等買入(6/19-) ▲0.005% 按分(95.0%) 3,473 億 11:50 国債補完供給(6/14-6/15) ▲0.600% 全取 97億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲1,000		+51,000		+1,000		▲5,000		
過不足	▲1,000		+50,100		+0		▲4,000		
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	
国債買入						+7,500			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲2,000		
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲1,000					+3,500	
社債等買入									
ETF買入									
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	▲1,500		+49,200		+7,500		▲2,500		
当座預金残高	3,513,500		3,562,700		3,570,200		3,567,700		
準備預金残高	3,160,200		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
積み終り先	3,160,200		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
超過準備	3,160,100		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
非準備預金残高	353,300		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
準備預金進捗率	100.0%		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
平均	96.8%		予想込増減	+49,200	予想込増減	+7,500	予想込増減	+5,500	
乖離率	3.2%		当預見込	3,562,700	当預見込	3,570,200	当預見込	3,575,700	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,998,100  
6/15以降の残り積み立て額(残り所要)積数 0  
6/15以降の残り積み立て額(残り所要)平均 0

	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G.C	-0.095	-0.095
ビッド	-0.060	0.000
レボG.C	-0.080	-0.080
出来値	-	-

6/13 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,554,300

(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
6/14	689 (3M)	-0.0991%	-0.1035%
6/8	688 (3M)	-0.0922%	-0.0970%
6/7	687 (6M)	-0.0982%	-0.1042%

6/13 のコール市場残高(前日比)

	合計	平均
有担	100,271	+8.983
無担	22,310	+391
無担	77,961	+8.592

\*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	-0.085	-	-	-	-0.050	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.055	-	-	-0.035	-0.042	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.088	-0.093	-	-0.087	-0.087	-0.101	-0.101	-	-0.102	-0.137	-0.184

## § 6/15 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。

## 6/15 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(16日まで)

## 6/15 の予定(海外)

米 6月のNY連銀製造業景況感指数  
週間新規失業保険申請件数  
5月鉱工業生産

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	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオベ	+49,200	3,562,700	+3,562,700	-0.086	-0.050	-0.030	-0.020	-0.020	-0.020	-0.020	-0.010	-0.010
				0.001	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
2017/6/12 ~ 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	0.00%	0.000%	-	札割れ
2017/6/12 ~ 2017/9/19	5,000	170	170	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
2017/6/5 ~ 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	0.10%	0.100%	-	札割れ
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	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
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	按分レド	平均レド	按分率	倍率
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	1.640%	固定金利	0.0%	1.00
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	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