

DAILY SIGNAL

平成29年6月16日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは323兆3,000億円だった。
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▲0.08~▲0.045%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。本日行われた日銀金融政策決定会合では、金融政策の現状維持が決定された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,233,000	3,233,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/16 のオペ結果
	6/16(金)		6/19(月)		6/20(火)		6/21(水)		
券	▲1,300		▲300		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ
財政	+3,500		▲7,600		+25,000		+2,000		10:10 ノーオペ
過不足	+2,200		▲7,900		+25,000		+1,000		11:50 国債補完供給(6/16-6/19) ▲0.600%全取 128億
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		+8,100		+6,900					13:00 ノーオペ
国庫短期証券買入									
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)			▲2,000	+1,800					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲100	+3,500					
社債等買入	▲200								
ETF買入		+700		+700					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲100	+100						
米ドル供給用担保国債供給					▲7,000	+26,400			
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+10,600		+3,000		+44,400		+1,000		
当座預金残高	3,573,200		3,576,200		3,620,600		3,621,600		
準備預金残高	3,195,100		3,195,100		3,195,100		3,195,100		
積み終了先	3,158,500		3,158,500		3,158,500		3,158,500		
超過準備	2,250,800		2,250,800		2,250,800		2,250,800		
非準備預金残高	378,100		378,100		378,100		378,100		
準備預金進捗率	98.0%		98.0%		98.0%		98.0%		
平均	10.0%		10.0%		10.0%		10.0%		
乖離率	88.0%		88.0%		88.0%		88.0%		
共通担保オペ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 4,920
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 88,941
									被災地金融機関支援 5,205
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,892,200
6/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 59,200
6/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,200

	T/N	T+2
無担 ユーロ円 CP現先 レボG.C		
オファー	-0.035	-0.080
ビッド	-0.065	-0.065
出来値	-	-

6/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,602,800**

(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
6/15	690 (1Y)	-0.1128%	-0.1158%
6/14	689 (3M)	-0.0991%	-0.1035%
6/8	688 (3M)	-0.0922%	-0.0970%

6/15 のコール市場残高(前日比)			
合計	95,459	-1,565	
有担	19,977	-440	
無担	75,482	-1,125	

*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	-0.080	-	-	-0.045	-0.055	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-0.030	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.060	-	-	-0.035	-0.045	-	-	-	0.050	-	-
東京レボ・レート	-0.078	-0.074	-	-0.083	-0.100	-0.098	-0.098	-	-0.101	-0.135	-0.183

§ 6/19 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.08~+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。

6/19 の予定(国内)

8:50 5月の貿易統計(財務省)
14:00 5月の実質輸出入の動向(日銀)

6/19 の予定(海外)

米 NY連銀総裁の講演
シコ連銀総裁の講演

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	+3,000	3,576,200	+3,576,200	-0.080	-0.055	-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

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
2017/6/19 ~ 2017/7/3	8,000	1,790	1,790	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 ~ 2017/6/26	8,000	2,580	2,580	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
2017/6/12 ~ 2017/9/19	5,000	170	170	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
2017/6/5 ~ 2017/6/19	8,000	1,950	1,950	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
2017/5/29 ~ 2017/6/12	8,000	2,680	2,680	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2017/5/22 ~ 2017/6/5	8,000	1,840	1,840	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
2017/5/15 ~ 2017/5/29	8,000	2,601	2,601	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
2017/5/8 ~ 2017/5/22	8,000	1,740	1,740	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。投資については最終決定は、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