

DAILY SIGNAL

平成29年6月21日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 6/21 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%の出合から始まった。
その後は▲0.075～▲0.045%の水準で取引が見られた。
後場では▲0.07%台で調整程度の出合が散見された。

	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				6/21 のオペ結果
	6/21(水)		6/22(木)		6/23(金)		6/26(月)		
券	▲1,300		▲1,500		▲2,000		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲2,500		▲8,400		+1,000		▲9,000		10:10 国債買入(6/23-)
過不足	▲3,800		▲9,900		▲1,000		▲9,000		(残存1年超3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	(残存3年超5年以下)
国債買入						+10,300			+0.007% 按分(81.6%) 2,801億
国庫短期証券買入		+10,000							(残存3年超5年以下)
国債買現先									+0.003% 按分(33.3%) 3,004億
国債売現先									(残存5年超10年以下)
共通担保(本店)									▲0.001% 按分(70.9%) 4,508億
共通担保(全店)							▲2,600		11:50
CP買現先	▲200		▲400						国債補完供給(6/21-6/22)
CP等買入									▲0.600% 全取 244億
社債等買入									12:50
ETF買入									ノーオペ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									
国債補完供給	+100	▲300	+300						
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	+5,800		▲10,000		+9,300		▲10,100		
当座預金残高	3,613,900		3,603,900		3,613,200		3,603,100		
準備預金残高	3,227,200		3,223,200		3,223,200		3,223,200		
積み増し先	3,223,200		3,223,200		3,223,200		3,223,200		共通担保オベ当社予想
超過準備	3,222,300		3,222,300		3,222,300		3,222,300		共通担保(全店) +8,000
非準備預金残高	386,700		386,700		386,700		386,700		共通担保(全店) 4,760
準備預金進捗率	99.4%		99.4%		99.4%		99.4%		国債買現先 0
平均	20.0%		20.0%		20.0%		20.0%		CP買現先 0
乖離率	79.4%		79.4%		79.4%		79.4%		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
6/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 16,100
6/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 700

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.035	-0.100
レボ	-0.070	0.000
ビッド	-	-
出来値	-	-

6/20 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,650,800**

(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%

6/20 のコール市場残高(前日比)		
合計	95,196	+1,738
有担	21,706	+285
無担	73,490	+1,453

*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	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.056	-	-	-0.017	-	-0.025	-	-	0.050	-	-
東京レボ・レート	-0.076	-0.068	-	-0.077	-0.091	-0.092	-0.094	-	-0.100	-0.131	-0.170

§ 6/22 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。
共通担保オベは期落ち分がロールオファーされると予想。

6/22 の予定(国内)

6月の月例経済報告(内閣府)
岩田日銀副総裁が青森県金融経済懇談会であいさつ
10:00 6月20日現在の営業毎旬報告(日銀)

6/22 の予定(海外)

米 5月の景気先行指数

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	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	▲10,000	3,603,900	+3,603,900	-0.086	-0.060	-0.020	-0.020	-0.010	-0.010	-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
2017/6/19 ~ 2017/7/3	8,000	1,790	1,790	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/6/12 ~ 2017/6/26	8,000	2,580	2,580	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/6/12 ~ 2017/9/19	5,000	170	170	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

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
6/22 ~ 6/29	担保範囲内	0	0	1.640%	固定金利	0.0%	応れなし
6/15 ~ 6/22	担保範囲内	2	2	1.640%	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