

DAILY SIGNAL

平成29年5月18日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 5/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは313兆3000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.045%の出合からスタート。
その後は▲0.065%～▲0.03%のレンジで取引された。
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	-	-	3,133,000	3,133,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/18 のオペ結果
	5/18(木)		5/19(金)		5/22(月)		5/23(火)		
券	+100		+200		+1,000		+1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲22,900		▲200		▲22,000		+3,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲22,800		+0		▲21,000		+4,000		11:50 国債補完供給(5/18-5/19) ▲0.600% 全取 192億
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				+10,500					13:00 共通担保(全店)<固定金利> (5/22-6/5) 0% 全取 1,840億
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)					▲1,700	+1,800			
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲100			+2,500			
社債等買入			▲100						
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+700	▲200	+200						
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	▲22,500		+10,500		▲18,400		+4,000		
当座預金残高	3,482,500		3,493,000		3,474,600		3,478,600		
準備預金残高	3,135,900		3,083,400		ノ-オペ		ノ-オペ		共通担保(全店) 4,731
積み終了先	3,051,100		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		国債買現先 0
超過準備	346,600		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		CP買現先 0
非準備預金残高	97.6%		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		成長基盤強化 81,054
準備預金進捗率	16.1%		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		被災地金融機関支援 5,254
平均	81.5%		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		ロンハート残高 0
乖離率	81.5%		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,989,500
5/19以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 70,400
5/19以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,500

	T/N	T+2
無担 ユーロ円 CP現先 レボG.C		
オファー	-0.025	-0.100
ビッド	-0.060	0.000
出来値	-	-

5/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,546,000

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	5/10
長期国債	282	361	387
CP等	2.2	2.3	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	13.7
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	39
その他とも資産計	383	476	498
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	354
その他とも負債・純資産計	383	476	498

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
5/18	684 (3M)	-0.1243%	-0.1287%
5/17	683 (1Y)	-0.1461%	-0.1561%
5/11	682 (3M)	-0.1243%	-0.1327%

5/17 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	91,467	20,322	71,145
	-801	+531	-1,332

*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	-	-	-0.025	-0.035	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.052	-0.001	-	-0.023	-0.015	-0.050	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.093	-0.086	-	-0.093	-0.101	-0.103	-0.107	-	-0.127	-0.176	-0.205

§ 5/19 オファーのオペと市場動向予想

明日の無担保コールON物は▲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。

5/19 の予定(国内)

特になし

5/19 の予定(海外)

特になし

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	+10,500	3,493,000	+3,493,000	-0.086	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-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	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2017/5/22 ~ 2017/6/5	8,000	1,840	1,840	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
2017/5/15 ~ 2017/5/29	8,000	2,601	2,601	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
2017/5/8 ~ 2017/5/22	8,000	1,740	1,740	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
2017/5/1 ~ 2017/5/15	8,000	2,550	2,550	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2017/4/24 ~ 2017/5/8	8,000	1,540	1,540	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2017/4/17 ~ 2017/5/1	8,000	2,650	2,650	0.00%	固定金利	-	札割れ	5/18 ~ 5/25	担保範囲内	1	1	1.410%	固定金利	0.0%	1.00
2017/4/10 ~ 2017/4/24	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	札割れ	5/11 ~ 5/18	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