

DAILY SIGNAL

平成29年5月26日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは315兆9000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.045%の出合からスタート。
その後は主に▲0.075～▲0.04%の水準で取引された。
調達一巡後は調整程度の出合が散見されてそのまま引けた。
本日発表された4月のCPI(生鮮食品を除く)は前年同月比+0.4%だった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,159,000	3,159,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/26 のオペ結果
	5/26(金)		5/29(月)		5/30(火)		5/31(水)		
券	▲800		+600		▲1,000		▲1,000		9:20 ノーオペ 10:10 国庫短期証券買入(5/30-) +0.000% 按分(52.0%) 5,000億 国債買入(5/30-) (残存5年超10年以下) ▲0.009% 按分(87.7%) 4,507億 (残存10年超25年以下) ▲0.010% 按分(74.0%) 2,006億 (残存25年超) ▲0.010% 按分(89.7%) 1,003億 10:40 CP等買入(5/31-) ▲0.010% 按分(19.4%) 2,500億 11:50 国債補完供給(5/26-5/29) ▲0.600% 全取 220億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
財政	+10,800		▲8,300		+1,000		+1,000		
過不足	+10,000		▲7,700		+0		+0		
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		+10,400				+7,500			
国庫短期証券買入						+5,000			
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)			▲2,600	+2,700					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲500					+2,500	
社債等買入	▲100	+1,000	▲100						
ETF買入				+400					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+100	▲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	+20,800		▲7,600		+12,500		+2,500		
当座預金残高	3,506,800		3,499,200		3,511,700		3,514,200		
準備預金残高	3,158,300								
積み終了先	3,157,900								
超過準備	3,157,100								
非準備先残高	348,500								
準備預金進捗率	99.8%								
平均	41.9%		予想込増減 ▲7,600		予想込増減 +12,500		予想込増減 +2,500		
乖離率	57.9%		当預見込 3,499,200		当預見込 3,511,700		当預見込 3,514,200		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,989.500
5/29 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 5,900
5/29 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 300

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.020	-
レボ	-0.100	-0.080
ビッド	-0.050	-
出来値	-	-
	0.000	-0.065

5/25 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,528,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	5/20
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	38
その他とも資産計	383	476	498
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	349
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
5/25	685 (3M)	-0.1182%	-0.1206%
5/18	684 (3M)	-0.1243%	-0.1287%
5/17	683 (1Y)	-0.1461%	-0.1561%

5/25 のコール市場残高(前日比)			
合計	92,155	+3,668	
有担	20,850	-858	
無担	71,305	+4,526	

*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	-	-	-0.050	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.055	-0.015	-	-0.020	-0.015	0.000	0.001	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.064	-0.061	-	-0.094	-0.095	-0.099	-0.101	-	-0.123	-0.172	-0.205

5/29 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。
共通担保オペはノーオペを予想。

5/29 の予定(国内)

特になし

5/29 の予定(海外)

米 休日
英 休日
欧 ドラギ 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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	▲7,600	3,499,200	+3,499,200	-0.086	-0.050	-0.050	-0.045	-0.045	-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)

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
2017/5/29 ~ 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
2017/5/1 ~ 2017/5/15	8,000	2,550	2,550	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/4/24 ~ 2017/5/8	8,000	1,540	1,540	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/4/17 ~ 2017/5/1	8,000	2,650	2,650	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
5/25 ~ 6/2	担保範囲内	0	0	1.410%	固定金利	0.0%	応れなし
5/18 ~ 5/25	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