

DAILY SIGNAL

平成29年5月12日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは264兆2000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は▲0.045~▲0.025%のレンジで取引された。調達一巡後は▲0.055%近辺で調整程度の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,642,000	2,642,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/12 のオペ結果
	5/12(金)		5/15(月)		5/16(火)		5/17(水)		
券		+1,500		+1,900		+1,000		+1,000	9:20 ノーオペ
財政		▲21,000		▲32,400		+5,000		+4,000	10:10 国庫短期証券買入(5/16-)
過不足		▲19,500		▲30,500		+6,000		+5,000	国債買入(5/16-)
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5年超10年以下)
国債買入		+10,500				+7,500			▲0.001% 按分(97.5%) 10,001億
国庫短期証券買入						+10,000			国債買入(5/16-)
国債買現先									(残存5年超10年以下)
国債売現先									▲0.001% 按分(69.4%) 4,503億
共通担保(本店)			▲2,600	+2,600					(残存10年超25年以下)
共通担保(全店)									+0.003% 按分(82.3%) 2,013億
CP買現先									(残存25年超)
CP等買入	▲300	+2,500	▲400						+0.009% 按分(50.0%) 1,002億
社債等買入									11:50
ETF買入									国債補完供給(5/12-5/15)
J-REIT買入									▲0.500% 全取 884億
被災地金融機関支援									12:50
貸出									ノーオペ
国債補完供給	+800	▲900	+900						13:00
米ドル供給用担保国債供給									ノーオペ
成長基盤強化支援									13:50
貸出増加支援									国債補完供給(5/12-5/15)
									▲0.500% 全取 30億
当座預金増減		▲6,900		▲30,000		+23,500		+5,000	
当座預金残高		3,506,800		3,476,800		3,500,300		3,505,300	
準備預金残高		3,150,200							
積み終了先		2,639,000							
超過準備		2,638,900							
非準備預金残高		356,600							
準備預金進捗率		100.0%							
平均		96.7%	予想込増減	▲30,000	予想込増減	+23,500	予想込増減	+5,000	
乖離率		3.3%	当預見込	3,476,800	当預見込	3,500,300	当預見込	3,505,300	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,240,700
5/15以降の残り積み立て額(残り所要)積数 0
5/15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	-0.025	-
レボ	-0.100	-0.090
ビッド	-0.060	-
レボ	0.000	-0.080
出来値	-	-

5/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,560,100

(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
5/11	682 (3M)	-0.1243%	-0.1327%
5/10	681 (6M)	-0.1302%	-0.1382%
5/1	680 (3M)	-0.1303%	-0.1395%

5/11のコール市場残高(前日比)			
合計	91,935		+363
有担	20,510		+2,232
無担	71,425		-1,869

*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	-0.070	-	-	-0.020	-	-	-0.020	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.230	-	-	0.003	-	-	-	-
加重平均	-0.037	-0.001	-	0.003	-	-	-0.019	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.087	-0.055	-	-0.097	-0.098	-0.103	-0.106	-	-0.129	-0.178	-0.207

5/15 オファーのオペと市場動向予想

5/15の予定(国内)

5/15の予定(海外)

積み最終日は▲0.07~+0.001%のレンジで取引されよう。 8:50 4月の企業物価指数(日銀)
共通担保オペはノーオペ予想。

米 5月のNY連銀製造業景況感指数
5月のNAHB住宅市場指数

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	当預増減	当預残高	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	▲30,000	3,476,800	+3,476,800	-0.070	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-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	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	倍率
2017/5/15 ~ 2017/5/29	8,000	2,601	2,601	0.00%	固定金利	-	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-
2017/5/8 ~ 2017/5/22	8,000	1,740	1,740	0.00%	固定金利	-	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-
2017/5/1 ~ 2017/5/15	8,000	2,550	2,550	0.00%	固定金利	-	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%
2017/4/24 ~ 2017/5/8	8,000	1,540	1,540	0.00%	固定金利	-	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	米ドル資金供給オペ						
2017/4/17 ~ 2017/5/1	8,000	2,650	2,650	0.00%	固定金利	-	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	倍率
2017/4/10 ~ 2017/4/24	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	5/11 ~ 5/18	担保範囲内	1	1	1.410%	固定金利	0.0%
2017/4/3 ~ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	0.00%	固定金利	-	4/27 ~ 5/11	担保範囲内	0	0	1.360%	固定金利	0.0%

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