

# DAILY SIGNAL

平成29年6月15日(木)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 6/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは320兆8,000億円だった。  
積み最終日となる本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まり、  
その後は▲0.08～▲0.035%のレンジで取引された。調達一巡後は調整程度の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	3,208,000	3,208,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				6/15 のオペ結果
	6/15(木)		6/16(金)		6/19(月)		6/20(火)		
券	▲900		▲700		+1,000		+0		9:20 ノーオペ
財政	+51,100		+4,600		▲5,000		+25,000		10:10 国債買入(6/19-)
過不足	+50,200		+3,900		▲4,000		+25,000		(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				+8,100		+6,800			▲0.002% 按分(12.7%) 2,806億
国庫短期証券買入									(残存3年超5年以下)
国債買現先									▲0.008% 按分(31.9%) 3,007億
国債売現先									(変動利付債)
共通担保(本店)									▲0.250% 按分(77.4%) 1,009億
共通担保(全店)					▲2,000	+1,800			11:50 国債補完供給(6/15-6/16)
CP買現先									▲0.600% 全取 61億
CP等買入	▲1,000		▲300			+3,500			12:50 ノーオペ
社債等買入			▲200						13:00 共通担保(全店)<固定金利>
ETF買入				+700					(6/19-7/3)
J-REIT買入									0% 全取 1,790億
被災地金融機関支援									13:50 国債補完供給(6/15-6/16)
貸出									▲0.600% 全取 100億
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	+49,100		+12,400		+6,100		+18,000		
当座預金残高	3,562,600		3,575,000		3,581,100		3,599,100		
準備預金残高	3,211,700		3,211,700		3,211,700		3,211,700		
積み終了先	3,211,700		3,211,700		3,211,700		3,211,700		
超過準備	350,900		350,900		350,900		350,900		
非準備預金残高	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		
共通担保オベ当社予想	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

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,892,200  
6/16以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,892,200  
6/16以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 96,400

	T/N	T+2
無担 ユーロ円 CP現先 レボG.C		
オファー	-0.030	-0.085
ビッド	-0.060	-0.065
出来値	-	-

6/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,552,800**

(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%

6/14のコール市場残高(前日比)		
合計	97,024	-3,247
有担	20,417	-1,893
無担	76,607	-1,354

\*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	-0.075	-	-	-0.035	-0.045	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	0.001	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.052	-	-	-0.028	-0.029	-	-0.045	-0.015	-	-	-
東京レボ・レート	-0.085	-0.087	-	-0.083	-0.100	-0.098	-0.099	-	-0.102	-0.135	-0.183

## § 6/16 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。  
共通担保オベはノーオペを予想。

## 6/16 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合の結果  
17:00 5月の業態別の日銀当座預金残高(日銀)

## 6/16 の予定(海外)

米 5月の住宅着工件数  
6月のシガン大学消費者信頼感速報

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	+12,400	3,575,000	+3,575,000	-0.086	-0.050	-0.030	-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	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

\*当日物

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
6/15 ~ 6/22	担保範囲内	2	2	1.640%	固定金利	0.0%	1.00
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