

DAILY SIGNAL

平成29年1月12日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは249兆8,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.025%の出合いから始まり、
▲0.03~▲0.02%のレンジで取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06~▲0.05%台の出合も見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,498,000	+2,498,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/12 のオペ結果
	1/12(木)		1/13(金)		1/16(月)		1/17(火)		
券	+3,000		+1,900		+3,000		+3,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(1/16-) (残存5年超10年以下) ▲0.008%按分(46.6%) 4,108億 (残存10年超25年以下) 0.000%按分(80.8%) 1,904億 (残存25年超) ▲0.007%按分(95.0%) 1,102億 11:50 国債補完供給(1/12-1/13) ▲0.500% 全取191億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)(固定金利) (1/16-1/30) 0% 全取 1,411億 (1/16-4/24) 0% 全取 210億 13:50 国債補完供給(1/12-1/13) ▲0.600% 全取 12億 共通担保(本店) 0 共通担保(全店) 3,260 国債買現先 0 CP買現先 0 成長基盤強化 76,205 被災地金融機関支援 5,090 ロンハート残高 0
財政	▲9,300		▲7,000		▲31,000		▲2,000		
過不足	▲6,300		▲5,100		▲28,000		+1,000		
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		+8,600				+7,100			
国庫短期証券買入		+17,500							
国債買現先					▲1,500	+1,600			
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先	▲300	+2,500	▲400						
CP等買入				+100					
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲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	+22,000		▲5,200		▲20,800		+1,000		
当座預金残高	3,314,800		3,309,600		3,288,800		3,289,800		
準備預金残高	2,972,400		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	2,494,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	2,494,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備先残高	342,400		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	99.9%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	90.3%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
乖離率	9.6%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
予想込増減	▲5,200		▲5,200		▲20,800		+1,000		
当預見込	3,309,600		3,309,600		3,288,800		3,289,800		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,222,400
1/13以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
1/13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	-0.020	-0.100
レボG.C	-	-0.105
ビッド	-	0.000
レボG.C	-	-0.090
出来値	-	-

1/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,342,700

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	1/10
長期国債	282	361	363
CP等	2.2	2.3	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	11.3
J-REIT	0.27	0.36	0.36
貸出支援基金	31	41	41
国庫短期証券	43	50	48
その他とも資産計	383	476	477
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	330
その他とも負債・純資産計	383	476	477

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
1/12	657(3M)	-0.2685%	-0.3086%
1/6	656(6M)	-0.3400%	-0.3501%
1/5	655(3M)	-0.3424%	-0.3618%

1/11のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
1/11	100,845	-568	+683
1/10	20,932	-	-
1/9	79,913	-1,251	-

*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	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.230	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.027	-	-	0.005	-	-0.020	0.000	-	-	-	-
東京レボレート	-0.087	-0.095	-	-0.097	-0.099	-0.102	-0.106	-	-0.154	-0.225	-0.228

§ 1/13 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.07~+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノオベを予想する。

1/13 の予定(国内)

8:50 マネ・ストック(12月)

1/13 の予定(海外)

米 イレシFRB議長講演(タウンホールミーティング)
シカン大消費者信頼感速報

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	当預増減	当預残高	着地残対比		ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノオベ	▲5,200	3,309,600	+3,309,600	-0.070	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.010	-0.010	-0.020	-0.030	
					~	~	~	~	~	~	~	~	~	
					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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2017/1/16 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	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				
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	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				
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	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				
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	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				
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/12/12 ~ 2016/12/26	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	-	札割れ	1/12 ~ 1/20	担保範囲内	350	350	1.160%	固定金利	-	1.00				
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	-	札割れ	1/6 ~ 1/12	担保範囲内	491	491	1.160%	固定金利	-	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