

DAILY SIGNAL

平成29年1月16日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは247兆1,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.035%の出合いから始まった。
その後は▲0.04~▲0.03%のレンジで出合いが見られた。
調達一巡後はヒッドが薄くなり、▲0.07~▲0.05%のレンジで出合いが散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,471,000	+2,471,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/16 のオペ結果
	1/16(月)		1/17(火)		1/18(水)		1/19(木)		
券	+2,500		+2,000		+2,000		+2,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(1/18-) (残存1年超3年以下) +0.004%按分(64.0%) 4,000億 (残存3年超5年以下) +0.003%按分(5.2%) 4,203億 (残存5年超10年以下) +0.003%按分(80.0%) 4,101億 11:50 国債補完供給(1/16-1/17) ▲0.500% 全取 2,027億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補完供給(1/16-1/17) ▲0.500% 全取 33億
財政	▲38,900		+3,700		+1,000		▲14,000		
過不足	▲36,400		+5,700		+3,000		▲12,000		
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		+7,400				+12,300			
国庫短期証券買入				+15,000					
国債買現先									
共通担保(本店)	▲1,500	+1,600							
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲900		▲400						
社債等買入									
ETF買入		+1,100							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+900	▲2,100	+2,100						
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									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲29,900		+22,400		+15,300		▲12,000		
当座預金残高	3,279,300		3,301,700		3,317,000		3,305,000		
準備預金残高	2,946,900								
積み終了先	954,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	713,800								
非準備先残高	332,400								
準備預金進捗率	78.8%								
平均	3.2%		予想込増減 +22,400		予想込増減 +15,300		予想込増減 ▲12,000		
乖離率	75.5%		当預見込 3,301,700		当預見込 3,317,000		当預見込 3,305,000		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,229,400
1/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 473,600
1/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 15,800

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.030	-	-0.100	-0.150
ヒッド	-0.040	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

1/13 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,354,100

(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	回号	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%

1/13 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	101,665	+1,499	
有担	19,980	-653	
無担	81,685	+2,152	

*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	-	-	-0.070	-0.035	-	-	-	-	-	-
最高	0.005	-	-	0.005	-0.030	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.047	-	-	-0.027	-0.034	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.105	-0.111	-	-0.104	-0.107	-0.110	-0.115	-	-0.154	-0.225	-0.228

§ 1/17 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。

1/17 の予定(国内)

8:50 11月のマネタリーサーベイ(日銀)
13:30 11月の鉱工業生産確報(経産省)

1/17 の予定(海外)

米 1月のNY連銀製造業景況感指数
NY連銀総裁の講演(NY)

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
◎ ノオベ	+22,400	3,301,700	+3,301,700	-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