

DAILY SIGNAL

平成29年1月17日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは248兆8,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.06%の出合いから始まり、
▲0.06～▲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、▲0.075～▲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	-	-	2,488,000	+2,488,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/17 のオペ結果
	1/17(火)		1/18(水)		1/19(木)		1/20(金)		
券	+2,000		+1,400		+2,000		▲1,000		9:20
財政	+1,400		+700		▲14,000		▲24,000		ノオベ
過不足	+3,400		+2,100		▲12,000		▲25,000		10:10
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	ノオベ
国債買入				+12,400					10:40
国庫短期証券買入		+15,000							CP買入(1/20-)
国債買現先									▲0.001% 按分(55.4%) 2,464億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(1/17-1/18)
CP買現先	▲400		▲200					+2,500	▲0.500% 全取 585億
CP等買入									12:50
社債等買入				+400					ノオベ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									ノオベ
被災地金融機関支援								+200	13:50
貸出									国債補完供給(1/17-1/18)
国債補完供給	+2,100	▲600	+600						▲0.500% 全取 18億
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	+19,500		+15,300		▲12,000		▲22,300		
当座預金残高	3,298,800		3,314,100		3,302,100		3,279,800		
準備預金残高	2,955,600		2,955,600		2,955,600		2,955,600		共通担保(本店)
積み終了先	2,345,000		2,345,000		2,345,000		2,345,000		共通担保(全店)
超過準備	2,181,200		2,181,200		2,181,200		2,181,200		国債買現先
非準備先残高	343,200		343,200		343,200		343,200		CP買現先
準備預金進捗率	92.1%		92.1%		92.1%		92.1%		成長基盤強化
平均	6.5%		6.5%		6.5%		6.5%		被災地金融機関支援
乖離率	85.6%		85.6%		85.6%		85.6%		ロンバート残高
			予想込増減	+15,300	予想込増減	▲12,000	予想込増減	▲22,300	
			当預見込	3,314,100	当預見込	3,302,100	当預見込	3,279,800	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,229,400
1/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 176,700
1/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 6,100

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

1/16 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,321,500

(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%

1/16 のコール市場残高(前日比)

	合計	93,678	-7,987
有担	19,268	-712	
無担	74,410	-7,275	

*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	-	-	-0.045	-0.030	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.025	-0.020	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	0.000	-	-0.031	-0.024	0.000	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.102	-0.105	-	-0.113	-0.114	-0.117	-0.120	-	-0.154	-0.225	-0.228

§ 1/18 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。

1/18 の予定(国内)

特になし

1/18 の予定(海外)

米 12月CPI
ベージュブック
イレブンFRB議長の講演

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
◎ ノオベ	+15,300	3,314,100	+3,314,100	-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