

DAILY SIGNAL

平成29年1月18日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは249兆5,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.04%の出合いからスタート。
▲0.065～▲0.03%のレンジで出合いが散見された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.07～▲0.05%のレンジで出合いが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,495,000	+2,495,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/18 のオペ結果
	1/18(水)		1/19(木)		1/20(金)		1/23(月)		
券	+1,400		+700		▲1,000		+2,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(1/20-) (残存5年超10年以下) ▲0.004%按分(5.2%) 4,105億 (残存10年超25年以下) ▲0.005%按分(1.7%) 1,908億 (残存25年超) ▲0.008%按分(33.1%) 1,103億 10:40 米ドル資金供給(1/20-1/26) 貸付利率1.16% 200百万米ドル 11:50 国債補完供給(1/18-1/19) ▲0.500% 全取5,614億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+1,600		▲10,600		▲24,000		▲21,000		
過不足	+3,000		▲9,900		▲25,000		▲19,000		
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	+12,400				+7,100				
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,700		
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲200				+2,500		
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出							+200		
国債補完供給									
米ドル供給用担保国債供給	+600		+5,700						
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	+10,500		▲4,300		▲15,200		▲20,700		
当座預金残高	3,309,300		3,305,000		3,289,800		3,269,100		
準備預金残高	2,966,200								
積み終了先	2,426,900								
超過準備	2,395,100								
非準備先残高	343,100								
準備預金進捗率	96.2%								
平均	9.7%		予想込増減 ▲4,300		予想込増減 ▲15,200		予想込増減 ▲12,700		
乖離率	86.6%		当預見込 3,305,000		当預見込 3,289,800		当預見込 3,277,100		
			ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
							共通担保(本店) 0		
							共通担保(全店) 3,371		
							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		
							ロンバート残高 0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,229,400
1/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 84,100
1/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 3,000

	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G.C	-	-0.100
レボG.C	-	-0.105
レボG.C	-0.040	-
レボG.C	-	0.000
レボG.C	-	-0.090
出来値	-	-

1/17 時点のマナタリーベース(単位:億円) **4,339,100**

(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
1/18	658(1Y)	-0.3261%	-0.3350%
1/12	657(3M)	-0.2685%	-0.3086%
1/6	656(6M)	-0.3400%	-0.3501%

1/17 のコール市場残高(前日比)

	合計	95,611	+1,933
有担	20,803	+1,535	
無担	74,808	+398	

*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	-0.078	-	-	-0.029	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.047	-	-	-0.021	-0.030	-	-0.030	-	-	-	-
東京レボレート	-0.100	-0.099	-	-0.111	-0.114	-0.115	-0.121	-	-0.154	-0.225	-0.228

§ 1/19 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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

1/19 の予定(国内)

8:50 前週の対外及び対内証券売買契約等の
状況(財務省)

1/19 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
12月の住宅着工件数
欧 ECBの金融政策発表、トランプ総裁の会見

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	▲4,300	3,305,000	+3,305,000	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2017/1/16 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/12/12 ~ 2016/12/26	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	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	按分率	平均レート	倍率
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
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0% 2.70

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
1/20 ~ 1/26	担保範囲内	200	200	1.160%	固定金利	- 1.00
1/12 ~ 1/20	担保範囲内	350	350	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ありません。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