

DAILY SIGNAL

§ 1/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは248兆1,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.03%の出合いから始まった。
その後は▲0.075～▲0.03%のレンジで出合いが見られた。
調達意欲は限定的で、後場に入るとビッドは薄くなり、そのまま引けた。

平成29年1月20日(金)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,481,000	+2,481,000

(単位:億円)

	日銀速報 1/20(金)		日銀予想 1/23(月)		当社需給予想				1/20 のオペ結果
	1/20(金)		1/23(月)		1/24(火)		1/25(水)		9:20 ノーオペ
券	+200		+900		+2,000		+1,000		10:10
財政	▲22,400		▲21,100		▲3,000		▲4,000		国庫短期証券買入(1/24-)
過不足	▲22,200		▲20,200		▲1,000		▲3,000		+0.013%全取 15,000億
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(1/24-)
国債買入		+7,600				+11,200			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入						+15,000			▲0.012%按分(94.2%) 4,003億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)			▲1,700	+1,600					▲0.007%按分(15.9%) 4,203億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先									+0.025%按分(92.5%) 1,901億
CP等買入	▲500	+2,500	▲200						(残存25年超)
社債等買入	▲100								+0.026%按分(48.4%) 1,104億
ETF買入		+100		+700					10:40
J-REIT買入									社債等買入(1/26-)
被災地金融機関支援		+200							▲0.150%按分(51.7%) 1,000億
貸出									11:50
国債補完供給	+5,600	▲5,700	+5,700						国債補完供給(1/20-1/23)
米ドル供給用担保国債供給									▲0.500% 全取 5,429億
成長基盤強化支援									12:50 ノーオペ
貸出増加支援									13:00 ノーオペ
当座預金増減	▲12,500		▲14,100		+25,200		▲3,000		13:50
当座預金残高	3,286,000		3,271,900		3,297,100		3,294,100		国債補完供給(1/20-1/23)
準備預金残高	2,946,000		2,946,400		2,946,400		2,946,400		▲0.500% 全取 222億
積み終了先	2,464,400		2,464,400		2,464,400		2,464,400		共通担保(本店)
超過準備	2,459,400		2,459,400		2,459,400		2,459,400		共通担保(全店)
非準備先残高	340,000		340,000		340,000		340,000		国債買現先
準備預金進捗率	99.2%		99.2%		99.2%		99.2%		CP買現先
平均	22.6%		22.6%		22.6%		22.6%		成長基盤強化
乖離率	76.6%		76.6%		76.6%		76.6%		被災地金融機関支援
									ロンバート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,229,400
1/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 18,800
1/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 800

(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
1/19	659(3M)	-0.2805%	-0.2861%
1/18	658(1Y)	-0.3261%	-0.3350%
1/12	657(3M)	-0.2685%	-0.3086%

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
オファー	-0.030	-0.100
レボG.C	-0.050	-0.090
ビッド	-0.050	-0.090
出来値	-	-

1/19 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,336,600

1/19 のコール市場残高(前日比)	合計	有担	無担
	97,354	21,025	+263
	76,329		+176
			+87

*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	-0.080	-	-	-0.070	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.046	-	-	-0.043	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.098	-0.092	-	-0.108	-0.112	-0.114	-0.119	-	-0.153	-0.225	-0.228

§ 1/23 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.08～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノーオペ予想。

1/23 の予定(国内)

月例経済報告(内閣府)

1/23 の予定(海外)

欧 ECB総裁講演
消費者信頼感(1月)

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
◎ ノーオペ	▲14,100	3,271,900	+3,271,900	-0.080	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.010	-0.010
				～	～	～	～	～	～	～
				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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率					
2017/1/23 ～ 2017/2/6		8,000	1,571	1,571	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	2015/11/18 ～ 2015/11/19		1,000	19	19	0.10%	0.100%	—	札割れ				
2017/1/16 ～ 2017/4/24		5,000	210	210	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	2012/6/1 ～ 2012/6/15		10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70				
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																							
米ドル資金供給オペ																															
期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	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