

DAILY SIGNAL

平成29年1月24日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは247兆9,000億円だった。
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。
調達一巡後はヒッドが薄くなり、▲0.075～▲0.05%の水準で推移し引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,479,000	+2,479,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/24 のオペ結果	
	1/24(火)		1/25(水)		1/26(木)		1/27(金)			
券	+100		+100		+0		+0		9:20	
財政	▲3,400		+5,800		▲5,000		▲1,000		ノーオペ	
過不足	▲3,300		+5,900		▲5,000		▲1,000		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	ノーオペ	
国債買入		+11,300		+5,000					10:40	
国庫短期証券買入		+15,100							米ドル資金供給(1/26-2/2)	
国債買現先									貸付利率1.160% 122百万米ドル	
共通担保(本店)									11:50	
共通担保(全店)									国債補完供給(1/24-1/25)	
CP買現先									▲0.500% 全取53億	
CP等買入	▲200		▲400						12:50	
社債等買入						+1,000			ノーオペ	
ETF買入				+100					13:00	
J-REIT買入									ノーオペ	
被災地金融機関支援										
貸出										
国債補完供給										
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	+22,900		+10,600		▲4,000		▲1,000			
当座預金残高	3,294,300		3,304,900		3,300,900		3,299,900			
準備預金残高	2,953,300								共通担保(本店)	
積み終了先	2,475,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)	
超過準備	2,475,400								国債買現先	
非準備先残高	341,000								CP買現先	
準備預金進捗率	99.4%								成長基盤強化	
平均	29.0%		予想込増減		+10,600	予想込増減	▲4,000	予想込増減	▲1,000	被災地金融機関支援
乖離率	70.4%		当預見込		3,304,900	当預見込	3,300,900	当預見込	3,299,900	ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,229,500
1/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 13,700
1/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.035	-	-0.100	-0.100
ヒッド	-0.050	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

1/23 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,308,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	1/20
長期国債	282	361	365
CP等	2.2	2.3	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	11.5
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	45
その他とも資産計	383	476	476
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	329
その他とも負債・純資産計	383	476	476

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
1/19	659(3M)	-0.2805%	-0.2861%
1/18	658(1Y)	-0.3261%	-0.3350%
1/12	657(3M)	-0.2685%	-0.3086%

1/23 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
1/23	98,870	-1,336	-278
1/22	19,489	-	-
1/21	79,381	-	-1,058

*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	-0.085	-	-	-0.062	0.000	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	0.001	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.050	-	-	-0.033	0.001	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.097	-0.093	-	-0.116	-0.115	-0.115	-0.119	-	-0.152	-0.225	-0.228

§ 1/25 オファ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。

1/25 の予定(国内)

8:50 12月の貿易統計(財務省)

1/25 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数

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	
◎	ノーオペ	+10,600	3,304,900	+3,304,900	-0.085	-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				
2017/1/16 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	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				
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	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				
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	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				
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	0.00%	固定金利	-	札割れ	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				
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	札割れ	1/26 ~ 2/2	担保範囲内	122	122	1.160%	固定金利	0.0%	1.00				
2016/12/12 ~ 2016/12/26	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	-	札割れ	1/20 ~ 1/26	担保範囲内	200	200	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