

DAILY SIGNAL

平成29年1月27日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは247兆7,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.035%の合出から始まった。
その後は▲0.08～▲0.03%のレンジで合出が見られた。
調達一巡後も地合に変化はなく、調整程度の合出が見られて引けた。
本日発表された12月のCPI(生鮮食品を除く)は前年同月比▲0.2%だった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,477,000	+2,477,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/27 のオペ結果
	1/27(金)		1/30(月)		1/31(火)		2/1(水)		
券	▲700		+700		▲1,000		+0		9:20
財政	+0		▲11,900		▲1,000		▲4,000		ノオペ
過不足	▲700		▲11,200		▲2,000		▲4,000		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	国庫短期証券買入(1/31-)
国債買入	+3,400				+12,700				▲0.010%按分(41.1%) 12,502億
国庫短期証券買入					+12,500				国債買入(1/31-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲1,400		+1,500				▲0.019%按分(99.3%) 4,003億
共通担保(全店)									(残存3年超5年以下)
CP買現先			▲400						▲0.012%按分(34.7%) 4,202億
CP等買入	▲200				+3,000				(残存5年超10年以下)
社債等買入	▲200								▲0.018%按分(70.5%) 4,503億
ETF買入		+200	+200						11:50
J-REIT買入									国債補完供給(1/27-1/30)
被災地金融機関支援									▲0.600% 全取 58億
貸出									12:50
国債補完供給	+200	▲100	+100						ノオペ
米ドル供給用担保国債供給									13:00
成長基盤強化支援									ノオペ
貸出増加支援									
当座預金増減	+2,600		▲11,200		+26,200		▲4,000		
当座預金残高	3,304,100		3,292,900		3,319,100		3,315,100		
準備預金残高	2,948,300								共通担保(本店)
積み終了先	2,474,100								共通担保(全店)
超過準備	2,473,800								国債買現先
非準備先残高	355,800								CP買現先
準備預金進捗率	99.7%								成長基盤強化
平均	45.2%		予想込増減	▲11,200	予想込増減	+26,200	予想込増減	▲4,000	被災地金融機関支援
乖離率	54.5%		当預見込	3,292,900	当預見込	3,319,100	当預見込	3,315,100	ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,230,200
1/30 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 6,700
1/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.035	-0.100
レボ	-0.045	-0.150
ビッド	-0.045	0.000
出来値	-	-

1/26 時点のマナターベース(単位:億円) 4,339,000

(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
1/26	660(3M)	-0.2525%	-0.2733%
1/19	659(3M)	-0.2805%	-0.2861%
1/18	658(1Y)	-0.3261%	-0.3350%

1/26 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
1/26	98,517	-247	+986
1/25	20,919		-1,233

*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	-	-	-0.070	-0.030	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.028	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.051	-	-	-0.044	-0.027	-	-0.020	-	-	-	-
東京レボレート	-0.096	-0.088	-	-0.121	-0.119	-0.119	-0.122	-	-0.152	-0.225	-0.228

§ 1/30 オフアのオペと市場動向予想

足許は▲0.085～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノオペ予想。

1/30 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(31日まで)
8:50 1月上旬の貿易統計(財務省)

1/30 の予定(海外)

米 12月の個人消費支出

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	
◎	ノオペ	▲11,200	3,292,900	+3,292,900	-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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	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				
2017/1/23 ~ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	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 ~ 2017/4/24	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				
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	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				
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
1900/1/4 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	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				
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	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