

DAILY SIGNAL

平成29年1月31日(火)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 1/31 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは249兆9000億円だった。

無担保コールON物は朝方▲0.035%の落ちから始まり、

その後は▲0.085～▲0.03%のレンジで取引された。

後場に入っても地合いは変わらず、そのまま引けた。

本で行われた日銀金融政策決定会合では金融政策の現状維持が決定された。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,499,000	+2,499,000

	日銀速報 1/31(火)		日銀予想 2/1(水)		当社需給予想				1/31 のオペ結果
	1/31(火)		2/1(水)		2/2(木)		2/3(金)		9:20 ノーオペ
券	+800		+500		▲1,000		▲1,000		10:10 ノーオペ
財政	+1,200		▲3,200		▲59,000		+2,000		10:40 ノーオペ
過不足	+2,000		▲2,700		▲60,000		+1,000		米ドル資金供給(2/2-2/9) 貸付利率1.160% 0百万米ドル
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	11:50 国債補完供給(1/31-2/1) ▲0.600% 全取549億
国債買入		+12,800							12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入		+12,500							13:00 ノーオペ
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲1,700	+3,000	▲100						
社債等買入	▲100								
ETF買入		+1,400							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+700	▲600	+600						
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	+30,000		▲2,200		▲60,000		+1,000		
当座預金残高	3,318,600		3,316,400		3,256,400		3,257,400		
準備預金残高	2,965,800								共通担保(本店) 0
積み終了先	2,497,300								共通担保(全店) 3,341
超過準備	2,497,300								国債買現先 0
非準備預金残高	352,800								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.7%								成長基盤強化 76,205
平均	51.6%		予想込増減 ▲2,200		予想込増減 ▲60,000		予想込増減 +1,000		被災地金融機関支援 5,251
乖離率	48.1%		当預見込 3,316,400		当預見込 3,256,400		当預見込 3,257,400		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,227,300

2/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 5,700

2/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

(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	回号	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%

	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	-0.170
ビッド	-0.080	-	0.000	-0.120
出来値	-	-	-	-

1/30 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,326,100

1/30 のコール市場残高(前日比)		
合計	98,260	-1,526
有担	21,041	+201
無担	77,219	-1,727

*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	-	-	-0.063	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.058	-	-	-0.034	-	0.005	0.003	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.106	-0.125	-	-0.110	-0.111	-0.114	-0.119	-	-0.153	-0.225	-0.228

§ 2/1 オファ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。

共通担保オペはノーオペ予想。

2/1 の予定(国内)

14:00 12月の基調的なインフレ率を捕捉するための指標(日銀)

2/1 の予定(海外)

米 FOMC声明発表

ADP雇用統計(1月)

ISM製造業景況指数(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	▲2,200	3,316,400	+3,316,400	-0.085	-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		
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	オファー額	応札額	落札額	按分レート	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			2/2 ～ 2/9	担保範囲内	0	0	1.160%	固定金利	0.0%	応札なし		
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		

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(登名)第 243号 加入協会 日本証券業協会