

DAILY SIGNAL

平成29年2月3日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは245兆円だった。
無担保コールON物は朝方▲0.035%の合出から始まり、その後は▲0.08～▲0.03%のレンジで取引された。後場に入っても地合に変化は見られず、そのまま引けた。
12時30分、日銀は固定利回り方式による国債買入オペ(通称:指値オペ)をオファー、落札額は7,239億円だった。

(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	-	-	2,450,000	+2,450,000

	日銀速報 2/3(金)		日銀予想 2/6(月)		当社需給予想				2/3 のオペ結果
					2/7(火)		2/8(水)		
券	+300		+1,500		+1,000		+1,000		9:20
財政	+3,600		▲31,200		+1,000		+2,000		ノーオペ
過不足	+3,900		▲29,700		+2,000		+3,000		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(2/7-)
国債買入		+11,700				+12,400			+0.011%按分(45.7%) 10,003億
国庫短期証券買入						+10,000			国債買入(2/7-)
国債買現先									(残存1年以下)
共通担保(本店)			▲1,600	+1,600					+0.089%按分(3.6%) 700億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先	▲100		▲300						+0.032%按分(61.3%) 4,504億
CP等買入									11:50
社債等買入									国債補完供給(2/3-2/6)
ETF買入		+100		+200					▲0.600% 全取 1,762億
J-REIT買入									12:30
被災地金融機関支援貸出									国債買入(固定利回り方式)
国債補完供給	+2,100	▲1,800	+1,800						(2/7-)
米ドル供給用担保国債供給									(残存5年超10年以下)
成長基盤強化支援貸出増加支援									固定利回較差0.006%
									全取 7,239億
									13:50
									国債補完供給(2/3-2/6)
									▲0.600% 全取 43億
当座預金増減	+15,900		▲28,000		+24,400		+3,000		
当座預金残高	3,255,900		3,227,900		3,252,300		3,255,300		
準備預金残高	2,910,900								
積み終了先	2,444,600								
超過準備	2,444,600								
非準備預金残高	345,000								
準備預金進捗率	99.8%								
平均	67.7%		予想込増減 ▲28,000		予想込増減 +24,400		予想込増減 +3,000		
乖離率	32.1%		当預見込 3,227,900		当預見込 3,252,300		当預見込 3,255,300		
									共通担保(全店) 3,341
									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 5,251
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,227,300
2/6 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,400
2/6 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	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	-0.110
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

2/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,276,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	1/31
長期国債	282	361	368
CP等	2.2	2.3	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	11.8
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	47
その他とも資産計	383	476	482
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	332
その他とも負債・純資産計	383	476	482

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
2/2	661(3M)	-0.2625%	-0.2709%
1/26	660(3M)	-0.2525%	-0.2733%
1/19	659(3M)	-0.2805%	-0.2861%

2/2 のコール市場残高(前日比)

合計	95,390	-7,549
有担	20,128	-66
無担	75,262	-7,483

*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	-	-	-0.020	-	-	-0.048	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.100	-	-	-0.005	-	-	-	-
加重平均	-0.050	-0.030	-	0.025	-	-0.020	-0.029	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.099	-0.088	-	-0.109	-0.109	-0.112	-0.119	-	-0.153	-0.225	-0.228

§ 2/6 オファター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を予想する。

2/6 の予定(国内)

9:00 12月の毎月勤労統計速報(厚労省)

2/6 の予定(海外)

米 フィラデルフィア連銀総裁の講演

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	▲28,000	3,227,900	+3,227,900	-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		
2017/2/6 ～ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	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		
2017/1/30 ～ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	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		
2017/1/23 ～ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	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 ～ 2017/4/24	5,000	210	210	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		
2017/1/16 ～ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	0.00%	固定金利	-	札割れ			米ドル資金供給オペ									
2017/1/10 ～ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	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 ～ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	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		
2016/12/26 ～ 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		

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