

DAILY SIGNAL

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

§ 3/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは243兆9000億円だった。
無担保コールON物は朝方▲0.025%の合出から始まった。
その後は▲0.076～▲0.025%の広いレンジで合出が見られた。
また一部で+0.001%で試取の動きが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,439,000	2,439,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/2 のオペ結果
	3/2(木)		3/3(金)		3/6(月)		3/7(火)		
券	▲1,100		▲400		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲47,400		▲3,400		▲3,000		▲1,000		ノオベ
過不足	▲48,500		▲3,800		▲2,000		+0		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	ノオベ
国債買入				+7,500					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(3/2-3/3)
国債買現先									▲0.500% 全取 26億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲1,600	+1,600			ノオベ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲100		▲300						共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入	▲100								(3/6-3/21)
ETF買入		+400							0% 全取 1,465億
J-REIT買入									(3/6-6/12)
被災地金融機関支援									0% 全取 170億
貸出									
国債補完供給	+100								
米ドル供給用担保国債供給			▲2,700	+5,600					
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲48,200		+6,300		▲2,000		+0		
当座預金残高	3,246,500		3,252,800		3,250,800		3,250,800		
準備預金残高	2,899,900								
積み終了先	2,439,500								共通担保オベ当社予想
超過準備	2,439,500								ノオベ
非準備先残高	346,600								ノオベ
準備預金進捗率	99.9%								共通担保(全店) 3,196
平均	53.6%		予想込増減 +6,300		予想込増減 ▲2,000		予想込増減 +0		国債買現先 0
乖離率	46.3%		当預見込 3,252,800		当預見込 3,250,800		当預見込 3,250,800		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) 2,016.600
3/3 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,700
3/3 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.010	-
レボ	-0.045	-
ビッド	-0.045	-
出来値	-	-

3/1 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,335,700

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	2/28
長期国債	282	361	376
CP等	2.2	2.3	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	12.3
J-REIT	0.27	0.36	0.37
貸出支援基金	31	41	41
国庫短期証券	43	50	44
その他とも資産計	383	476	488
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	330
その他とも負債・純資産計	383	476	488

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
3/2	667(3M)	-0.3326%	-0.3466%
2/23	666(3M)	-0.2505%	-0.2593%
2/16	665(3M)	-0.2024%	-0.2156%

3/1 のコール市場残高(前日比)			
合計	100,298	+14,934	
有担	20,691	+258	
無担	79,607	+14,676	

*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	-0.076	-	-	-0.019	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.002	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.042	0.000	-	-0.010	0.000	-0.018	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.094	-0.101	-	-0.106	-0.109	-0.113	-0.166	-	-0.145	-0.201	-0.218

§ 3/3 オファ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。
共通担保オベはノオベ予想。

3/3 の予定(国内)

8:30 CPI(全国1月、東京都区部2月)(総務省)
1月の完全失業率(総務省)
14:00 1月の基調的なインフレ率を補正するための指標速報(日銀)

3/3 の予定(海外)

米 イレソFRB議長の講演(シカゴ)
フィッシャーFRB副議長の講演(NY)
2月のISM非製造業指数

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
◎ ノオベ	+6,300	3,252,800	+3,252,800	-0.080	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.010	-0.010	-0.010	-0.010
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2017/3/6 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	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				
2017/3/6 ~ 2017/3/21	8,000	1,465	1,465	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				
2017/2/27 ~ 2017/3/13	8,000	1,370	1,370	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				
2017/2/20 ~ 2017/3/6	8,000	1,516	1,516	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				
2017/2/13 ~ 2017/2/27	8,000	1,430	1,430	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ											
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	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	3/2 ~ 3/9	担保範囲内	1	1	1.160%	固定金利	0.0%	1.00				
2017/1/23 ~ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	0.00%	固定金利	-	札割れ	2/24 ~ 3/2	担保範囲内	202	202	1.140%	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