

DAILY SIGNAL

平成29年3月10日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは249兆7000億円だった。
無担保コールON物は▲0.025%の合出から始まり、朝方は
▲0.05～▲0.02%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、
▲0.075%近辺で合出が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,497,000	2,497,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/10 のオペ結果
	3/10(金)		3/13(月)		3/14(火)		3/15(水)		
券	+100		+1,100		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	+1,300		▲15,300		+4,000		+16,000		10:10 ノーオペ
過不足	+1,400		▲14,200		+4,000		+16,000		9:20 ノーオペ
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	10:10 ノーオペ
国債買入		+8,000							9:20 ノーオペ
国庫短期証券買入									10:10 ノーオペ
国債買現先									9:20 ノーオペ
共通担保(本店)			▲1,400	+1,300					10:10 ノーオペ
共通担保(全店)									9:20 ノーオペ
CP買現先									10:10 ノーオペ
CP等買入	▲100	+5,000	▲600						9:20 ノーオペ
社債等買入			▲100						10:10 ノーオペ
ETF買入		+600							9:20 ノーオペ
J-REIT買入									10:10 ノーオペ
被災地金融機関支援									9:20 ノーオペ
貸出									10:10 ノーオペ
国債補完供給	+400	▲300	+300						9:20 ノーオペ
米ドル供給用担保国債供給									10:10 ノーオペ
成長基盤強化支援									9:20 ノーオペ
貸出増加支援									10:10 ノーオペ
当座預金増減	+15,000		▲14,700		+16,500		+16,000		11:50 ノーオペ
当座預金残高	3,280,200		3,265,500		3,282,000		3,298,000		13:00 ノーオペ
準備預金残高	2,955,100		2,946,700		2,956,000		2,966,000		13:00 ノーオペ
積み終了先	2,496,700		2,496,600		2,496,600		2,496,600		13:00 ノーオペ
超過準備	2,496,600		2,496,600		2,496,600		2,496,600		13:00 ノーオペ
非準備先残高	325,100		325,100		325,100		325,100		13:00 ノーオペ
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		13:00 ノーオペ
平均	89.3%		89.3%		89.3%		89.3%		13:00 ノーオペ
乖離率	10.7%		10.7%		10.7%		10.7%		13:00 ノーオペ
当座預金増減	+15,000		▲14,700		+16,500		+16,000		13:00 ノーオペ
当座預金残高	3,280,200		3,265,500		3,282,000		3,298,000		13:00 ノーオペ
準備預金残高	2,955,100		2,946,700		2,956,000		2,966,000		13:00 ノーオペ
積み終了先	2,496,700		2,496,600		2,496,600		2,496,600		13:00 ノーオペ
超過準備	2,496,600		2,496,600		2,496,600		2,496,600		13:00 ノーオペ
非準備先残高	325,100		325,100		325,100		325,100		13:00 ノーオペ
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		13:00 ノーオペ
平均	89.3%		89.3%		89.3%		89.3%		13:00 ノーオペ
乖離率	10.7%		10.7%		10.7%		10.7%		13:00 ノーオペ
当座預金増減	+15,000		▲14,700		+16,500		+16,000		13:00 ノーオペ
当座預金残高	3,280,200		3,265,500		3,282,000		3,298,000		13:00 ノーオペ
準備預金残高	2,955,100		2,946,700		2,956,000		2,966,000		13:00 ノーオペ
積み終了先	2,496,700		2,496,600		2,496,600		2,496,600		13:00 ノーオペ
超過準備	2,496,600		2,496,600		2,496,600		2,496,600		13:00 ノーオペ
非準備先残高	325,100		325,100		325,100		325,100		13:00 ノーオペ
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		13:00 ノーオペ
平均	89.3%		89.3%		89.3%		89.3%		13:00 ノーオペ
乖離率	10.7%		10.7%		10.7%		10.7%		13:00 ノーオペ
当座預金増減	+15,000		▲14,700		+16,500		+16,000		13:00 ノーオペ
当座預金残高	3,280,200		3,265,500		3,282,000		3,298,000		13:00 ノーオペ
準備預金残高	2,955,100		2,946,700		2,956,000		2,966,000		13:00 ノーオペ
積み終了先	2,496,700		2,496,600		2,496,600		2,496,600		13:00 ノーオペ
超過準備	2,496,600		2,496,600		2,496,600		2,496,600		13:00 ノーオペ
非準備先残高	325,100		325,100		325,100		325,100		13:00 ノーオペ
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		13:00 ノーオペ
平均	89.3%		89.3%		89.3%		89.3%		13:00 ノーオペ
乖離率	10.7%		10.7%		10.7%		10.7%		13:00 ノーオペ

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,020,700
3/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
3/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.010	-0.100
レボG.C	-	-0.095
ビッド	-0.040	0.000
レボG.C	-	-0.080
出来値	-	-

3/9 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,305,700

(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
3/9	669 (3M)	-0.4006%	-0.4459%
3/8	668 (6M)	-0.3328%	-0.3564%
3/2	667 (3M)	-0.3326%	-0.3466%

3/9 のコール市場残高(前日比)

	合計	95,682	+1,169
有担	20,450	+1,234	
無担	75,232	-65	

*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	-0.075	-	-	-0.018	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.100	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.029	0.000	-	0.007	-	-	0.003	-	-	-	-
東京レボレート	-0.094	-0.081	-	-0.123	-0.125	-0.231	-0.205	-	-0.159	-0.204	-0.223

§ 3/13 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.075～+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。

3/13 の予定(国内)

8:50 2月の企業物価指数(日銀)
1月のマネタリーサーベイ(日銀)
1月の機械受注(内閣府)

3/13 の予定(海外)

米 FRBの2月の労働市場情勢指数

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	-14,700	+3,265,500	+3,265,500	-0.075	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-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)

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
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/3/6 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/3/6 ~ 2017/3/21	8,000	1,465	1,465	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/2/27 ~ 2017/3/13	8,000	1,370	1,370	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/2/20 ~ 2017/3/6	8,000	1,516	1,516	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/2/13 ~ 2017/2/27	8,000	1,430	1,430	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	0.00%	固定金利	-	札割れ

*当日物

共通担保資金供給(本店)

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
2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
米ドル資金供給オペ							
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
3/9 ~ 3/16	担保範囲内	2	2	1.150%	固定金利	0.0%	1.00
3/2 ~ 3/9	担保範囲内	1	1	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