

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 国庫短期証券買入(3/14-)
過不足	+1,400		▲14,200		+4,000		+16,000		+0.034%全取 2,500億
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	国債買入(3/14-)
国債買入		+8,000							+0.010%按分(82.2%) 3,001億
国庫短期証券買入						+10,000			(残存1年超3年以下)
国債買現先						+2,500			+0.010%按分(82.2%) 3,001億
共通担保(本店)			▲1,400	+1,300					(残存3年超5年以下)
共通担保(全店)									▲0.005%按分(53.0%) 4,004億
CP買現先									(残存10年超25年以下)
CP等買入	▲100	+5,000	▲600						+0.006%按分(90.7%) 2,006億
社債等買入			▲100						(残存25年超)
ETF買入		+600							+0.003%按分(40.0%) 1,002億
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(3/10-3/13)
貸出									▲0.500% 全取 279億
国債補完供給	+400	▲300	+300						12:50
米ドル供給用担保国債供給									ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノーオペ
当座預金増減	+15,000		▲14,700		+16,500		+16,000		
当座預金残高	3,280,200		3,265,500		3,282,000		3,298,000		
準備預金残高	2,955,100		2,966,700		2,966,700		2,966,700		
積み終了先	2,496,700		2,496,700		2,496,700		2,496,700		
超過準備	2,496,600		2,496,600		2,496,600		2,496,600		
非準備先残高	325,100		325,100		325,100		325,100		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
平均	89.3%		89.3%		89.3%		89.3%		
乖離率	10.7%		10.7%		10.7%		10.7%		
共通担保オペ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 3,215
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 81,054
									被災地金融機関支援 5,251
									ロンハート残高 0

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	-0.095
ビッド	-0.040	0.000
レボG.C	-0.080	-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)				*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	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-
2017/3/6 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	0.00%	固定金利	-	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-
2017/3/6 ~ 2017/3/21	8,000	1,465	1,465	0.00%	固定金利	-	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%
2017/2/27 ~ 2017/3/13	8,000	1,370	1,370	0.00%	固定金利	-	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2017/2/20 ~ 2017/3/6	8,000	1,516	1,516	0.00%	固定金利	-	米ドル資金供給オペ						
2017/2/13 ~ 2017/2/27	8,000	1,430	1,430	0.00%	固定金利	-	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	-	3/9 ~ 3/16	担保範囲内	2	2	1.150%	固定金利	0.0%
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	0.00%	固定金利	-	3/2 ~ 3/9	担保範囲内	1	1	1.160%	固定金利	0.0%

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