

DAILY SIGNAL

平成29年3月13日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは248兆5000億円だった。
無担保コールON物は▲0.06%の出合から始まり、朝方は▲0.08～▲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、調整程度の出合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	-	-	2,485,000	2,485,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/13 のオペ結果
	3/13(月)		3/14(火)		3/15(水)		3/16(木)		
券	+1,200		+100		+0		+0		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(3/15-) (残存1年以下) ゼロ%按分(7.0%) 702億 (残存5年超10年以下) ▲0.006%按分(11.6%) 4,509億 11:50 国債補完供給(3/13-3/14) ▲0.500% 全取 479億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補完供給(3/13-3/14) ▲0.500% 全取 1億
財政	▲16,700		+3,700		▲16,000		+4,000		
過不足	▲15,500		+3,800		▲16,000		+4,000		
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				+10,300		+5,200			
国庫短期証券買入				+2,500					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲1,400	+1,300							
CP買現先			▲100						
CP等買入	▲600								
社債等買入	▲100								
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+300	▲500	+500						
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	▲16,500		+17,000		▲10,800		+4,000		
当座預金残高	3,263,700		3,280,700		3,269,900		3,273,900		
準備預金残高	2,945,600								
積み終了先	2,489,000								
超過準備	2,489,000								
非準備先残高	318,100								
準備預金進捗率	100.0%								
平均	92.9%		予想込増減 +17,000		予想込増減 ▲10,800		予想込増減 +4,000		
乖離率	7.1%		当預見込 3,280,700		当預見込 3,269,900		当預見込 3,273,900		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,020,700
3/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
3/14 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	-	-0.100
レボG.C	-	-0.095
ビッド	-0.040	-
レボG.C	-	-0.085
出来値	-	-

3/10 時点のマナターベース(単位:億円) 4,320,600

(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%

3/10 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	96,152	+470	
有担	19,569	-881	
無担	76,583	+1,351	

*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	-0.080	-	-	-0.008	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	-	-	-0.005	-0.015	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.089	-0.085	-	-0.120	-0.121	-0.288	-0.233	-	-0.159	-0.204	-0.223

§ 3/14 オファター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。
共通担保オペはノオベ予想。

3/14 の予定(国内)

10:00 3月10日現在の営業毎旬報告(日銀)
日銀の保有する国債の銘柄別残高
日銀の国庫短期証券の銘柄別買入額

3/14 の予定(海外)

米 FOMC(15日まで)
生産者物価指数(2月)
ユーロ圏 鉱工業生産(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	S6M	S1Y
◎ ノオベ	+17,000	+3,280,700	+3,280,700	-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
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	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 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	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
2017/3/6 ~ 2017/3/21	8,000	1,465	1,465	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
2017/2/27 ~ 2017/3/13	8,000	1,370	1,370	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
2017/2/20 ~ 2017/3/6	8,000	1,516	1,516	0.00%	固定金利	-	札割れ	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	-	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
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	-	札割れ	3/9 ~ 3/16	担保範囲内	2	2	1.150%	固定金利	0.0%	1.00
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

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