

DAILY SIGNAL

平成29年3月14日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは250兆3000億円だった。
無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まり、
その後は▲0.08～▲0.02%のレンジで取引された。
昨日に引き続き、地合いは弱含み、加重平均金利は
前日比▲0.005%の▲0.053%となった。

(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	-	-	2,503,000	2,503,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/14 のオペ結果
	3/14(火)		3/15(水)		3/16(木)		3/17(金)		
券	+200		▲500		+0		▲1,000		9:20
財政	+3,000		▲15,600		+4,000		+7,000		ノーオペ
過不足	+3,200		▲16,100		+4,000		+6,000		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	ノーオペ
国債買入		+10,300		+5,300					10:40
国庫短期証券買入		+2,500							米ドル資金供給(3/16-3/23)
国債買現先									貸付利率1.390% 4百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(3/14-3/15)
CP買現先	▲100		▲1,400						▲0.500% 全取 2,597億
CP等買入									12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									14:45
貸出									米ドル資金供給用担保国債
国債補完供給	+500	▲2,700	+2,700						供給(売現先)(3/15-3/24)
米ドル供給用担保国債供給									▲0.100% 全取 2億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+13,700		▲9,500		+4,000		▲12,800		
当座預金残高	3,277,400		3,267,900		3,271,900		3,259,100		
準備預金残高	2,955,900		2,955,900		2,955,900		2,955,900		
積み終了先	2,500,600		2,500,600		2,500,600		2,500,600		共通担保オペ当社予想
超過準備	2,500,600		2,500,600		2,500,600		2,500,600		ノーオペ
非準備先残高	321,500		321,500		321,500		321,500		ノーオペ
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		ノーオペ
平均	96.4%		96.4%		96.4%		96.4%		共通担保(全店) 3,145
乖離率	3.6%		3.6%		3.6%		3.6%		国債買現先 0
			予想込増減 ▲9,500	予想込増減 +4,000	予想込増減 ▲12,800				CP買現先 0
			当預見込 3,267,900	当預見込 3,271,900	当預見込 3,259,100				成長基盤強化 81,054
									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) 2,020,800
3/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
3/15 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 -0.095
ビッド	-	0.000 -0.085
出来値	-	- -

3/13 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,303,000

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	3/10
長期国債	282	361	380
CP等	2.2	2.3	2.6
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	12.6
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	43
その他とも資産計	383	476	491
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	328
その他とも負債・純資産計	383	476	491

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
3/14	670 (1Y)	-0.2500%	-0.2839%
3/9	669 (3M)	-0.4006%	-0.4459%
3/8	668 (6M)	-0.3328%	-0.3564%

3/13 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	91,626	-4,526	-1,202
	20,771	+1,202	-5,728
	70,855		

*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	-0.083	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.005	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	0.005	-	0.003	-0.025	-	-0.010	-	-	-	-
東京レボレート	-0.089	-0.088	-	-0.118	-0.119	-0.331	-0.247	-	-0.163	-0.204	-0.223

§ 3/15 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.086～+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。

3/15 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(16日まで)

3/15 の予定(海外)

米 FOMCの結果
FRB議長の見聞
週間MBA住宅ローン申請指数

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	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	-9,500	+3,267,900	+3,267,900	-0.086	-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	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	3/16 ~ 3/23	担保範囲内	4	4	1.390%	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	3/9 ~ 3/16	担保範囲内	2	2	1.150%	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