

DAILY SIGNAL

平成29年3月17日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは254兆4000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、
その後は▲0.07～▲0.02%の水準で取引された。
調達一巡後はヒッドが薄くなり、▲0.08%台の出合も見られた。
また、昨日に引き続き一部で試し取りの動きが見られ、0%近傍での取引が散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,544,000	2,544,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/17 のオペ結果
	3/17(金)		3/21(火)		3/22(水)		3/23(木)		
券	▲1,400		+100		+0		▲1,000		9:20
財政	+5,300		+55,500		+9,000		+4,000		ノーオペ
過不足	+3,900		+55,600		+9,000		+3,000		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	国庫短期証券買入(3/22-)
国債買入		+10,400							+0.002%按分(64.7%) 5,000億
国庫短期証券買入						+5,000			10:40
国債買現先									CP等買入(3/23-)
共通担保(本店)			▲1,500	+3,100					▲0.032%按分(10.0%) 4,996億
共通担保(全店)									11:50
CP買現先									国債補完供給(3/17-3/21)
CP等買入	▲600		▲1,100						▲0.500% 全取 4,235億
社債等買入	▲400								12:50
ETF買入									ノーオペ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:50
国債補完供給	+1,500	▲4,400	+4,400						国債補完供給(3/17-3/21)
米ドル供給用担保国債供給									▲0.500% 全取 25億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援	▲31,700	+75,200							
当座預金増減	+53,900		+60,500		+14,000		+8,000		
当座預金残高	3,322,200		3,382,700		3,396,700		3,404,700		
準備預金残高	2,981,400								
積み終了先	2,512,900								
超過準備	2,428,500								
非準備先残高	340,800								
準備預金進捗率	98.5%								
平均	6.5%		予想込増減 +60,500		予想込増減 +14,000		予想込増減 +8,000		
乖離率	92.0%		当預見込 3,382,700		当預見込 3,396,700		当預見込 3,404,700		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,243,400
3/21 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 34,200
3/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,300

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.015	-	-0.100	-0.085
ヒッド	-0.040	-	0.000	-0.070
出来値	-	-	-	-

3/16 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,308,600

(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
3/15	671(3M)	-0.3039%	-0.3271%
3/14	670(1Y)	-0.2500%	-0.2839%
3/9	669(3M)	-0.4006%	-0.4459%

3/16 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	87,500	-6,307	-346
	19,332	-	-
	68,168	-5,961	-

*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	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.039	0.000	-	-0.023	-0.015	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.078	-	-0.108	-0.390	-0.310	-0.261	-	-0.170	-0.204	-0.223

§ 3/21 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。
共通担保オペはノーオペ予想。

3/21 の予定(国内)

9:00 2月の公社債投資家別売買状況(日証協)

3/21 の予定(海外)

米 10～12月経常収支

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	+60,500	3,382,700	+3,382,700	-0.080	-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				
2017/3/21 ~ 2017/4/3	8,000	3,050	3,050	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				
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	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 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	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				
2017/3/6 ~ 2017/3/21	8,000	1,465	1,465	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				
2017/2/27 ~ 2017/3/13	8,000	1,370	1,370	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2017/2/20 ~ 2017/3/6	8,000	1,516	1,516	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				
2017/2/13 ~ 2017/2/27	8,000	1,430	1,430	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				
2017/2/6 ~ 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				

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