

DAILY SIGNAL

平成29年3月21日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは253兆9000億円だった。
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▲0.065～▲0.025%の水準で取引された。
後場は大きな動きはなく、そのまま引けとなった。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,539,000	2,539,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/21 のオペ結果
	3/21(火)		3/22(水)		3/23(木)		3/24(金)		
券	+300		+200		▲1,000		▲2,000		9:20
財政	+54,900		▲4,200		+4,000		+17,000		ノオベ
過不足	+55,200		▲4,000		+3,000		+15,000		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	国債買入(3/23-)
国債買入									(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+5,000		+11,500			+0.001% 按分(10.1%) 3,002億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.006% 按分(9.2%) 4,001億
共通担保(全店)	▲1,500	+3,100							(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.008% 按分(87.8%) 4,507億
CP等買入	▲1,100		▲400			+5,000			10:40
社債等買入			▲100						米ドル資金供給(3/23-3/30)
ETF買入				+500					貸付利率 1.420% 2百万米ドル
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(3/21-3/22)
貸出									▲0.500% 全取 4,187億
国債補完供給	+4,400	▲4,300	+4,300						12:50
米ドル供給用担保国債供給									ノオベ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノオベ
									13:50
									国債補完供給(3/21-3/22)
									▲0.500% 全取 21億
当座預金増減	+55,800		+5,300		+19,500		+15,000		
当座預金残高	3,378,000		3,383,300		3,402,800		3,417,800		
準備預金残高	3,043,600								
積み終了先	2,531,300								共通担保オベ当社予想
超過準備	2,524,600								ノオベ
非準備先残高	334,400								ノオベ
準備預金進捗率	98.9%								ノオベ
平均	19.4%		予想込増減 +5,300		予想込増減 +19,500		予想込増減 +15,000		共通担保(全店) 4,730
乖離率	79.6%		当預見込 3,383,300		当預見込 3,402,800		当預見込 3,417,800		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) 2,243,400
3/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 24,400
3/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,000

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.015	-0.100
レボG.C	-0.080	-0.080
ビッド	-0.040	0.000
レボG.C	-0.065	-0.065
出来値	-	-

3/17 時点のマナターベース(単位:億円) 4,364,000

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

3/17 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	99,230	+11,730	-297
	19,035	-	-
	80,195	+12,027	-

*出所:営業毎報告
*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	-	-	-0.010	-0.001	-	-	-	-	-	-
最高	0.010	-	-	0.100	0.030	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.042	0.000	-	0.045	0.009	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.088	-0.071	-	-0.105	-0.414	-0.319	-0.258	-	-0.166	-0.204	-0.223

§ 3/22 オフア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。
共通担保オベはノオベ予想。

3/22 の予定(国内)

8:50 1月30～31日の金融政策会合議事要旨(日銀)
2月の貿易統計(財務省)

3/22 の予定(海外)

米 2月の中古住宅販売件数
10:00 3月20日の営業毎報告(日銀)

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	+5,300	3,383,300	+3,383,300	-0.080	-0.040	-0.030	-0.030	-0.030	-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)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2017/3/21 ~ 2017/4/3	8,000	3,050	3,050	0.00%	固定金利	札割れ
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

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	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%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%

米ドル資金供給オベ

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
3/23 ~ 3/30	担保範囲内	2	2	1.420%	固定金利	0.0%
3/16 ~ 3/23	担保範囲内	4	4	1.390%	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