

DAILY SIGNAL

§ 3/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは252兆6000億円だった。
 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%のレンジで出合が見られた。
 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引けた。

平成29年3月22日(水)
 上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,526,000	2,526,000

(単位:億円)

	日銀速報 3/22(水)		日銀予想 3/23(木)		当社需給予想 3/24(金)		3/27(月)		3/22 のオペ結果 9:20 ノーオペ 10:10 ノーオペ 11:50 国債補完供給(3/22-3/23) ▲0.500% 全取 3,453億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ 13:50 ノーオペ
券		+200		▲1,400		▲2,000		+0	
財政		▲6,100		+1,700		+17,000		+14,000	
過不足		▲5,900		+300		+15,000		+14,000	
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				+11,600					
国庫短期証券買入		+5,000							
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,300		
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲300	+5,000					
社債等買入	▲100								
ETF買入		+500							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援 貸出									
国債補完供給	+4,300	▲3,600	+3,600						
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	▲200		+20,200		+15,000		+12,700		
当座預金残高	3,377,800		3,398,000		3,413,000		3,425,700		
準備預金残高	3,024,600								
積み終了先	2,513,800		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 4,730
超過準備	2,513,700								国債買現先 0
非準備先残高	353,200								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.1%								成長基盤強化 81,054
平均	22.6%		予想込増減 +20,200		予想込増減 +15,000		予想込増減 +20,700		被災地金融機関支援 5,251
乖離率	76.5%		当預見込 3,398,000		当預見込 3,413,000		当預見込 3,433,700		ロンバード残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,243,400
 3/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 21,100
 3/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 900

	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
ビッド	-0.040	-	0.000	-0.070
出来値	-	-	-	-

3/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,419,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	3/20
長期国債	282	361	381
CP等	2.2	2.3	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	12.7
J-REIT	0.27	0.36	0.38
貸出支援基金	31	41	37
国庫短期証券	43	50	42
その他とも資産計	383	476	495
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	332
その他とも負債・純資産計	383	476	495

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%

3/21 のコール市場残高(前日比)

合計	94,238	-4,992
有担	20,837	+1,802
無担	73,401	-6,794

*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	-	-	-0.025	0.000	-	-	-	-	-	-
最高	0.010	-	-	-0.010	0.060	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.039	0.000	-	-0.017	0.009	-0.020	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.086	-0.073	-	-0.102	-0.496	-0.392	-0.267	-	-0.168	-0.204	-0.223

§ 3/23 オファ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。
 共通担保オペは期落ち分をロール予想。

3/23 の予定(国内)

国債投資家懇談会(財務省)

3/23 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
 FRB議長の講演
 ユーロ 3月の消費者信頼感指数

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
◎ ノーオペ	+20,200	3,398,000	+3,398,000	-0.075	-0.040	-0.030	-0.030	-0.030	-0.010	-0.010
				～	～	～	～	～	～	～
				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	按分レート	平均レート	按分率	倍率			期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	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	按分レート	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			3/23 ～ 3/30	担保範囲内	2	2	1.420%	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			3/16 ～ 3/23	担保範囲内	4	4	1.390%	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なく、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