

DAILY SIGNAL

平成29年3月28日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは256兆4000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.04%の出合から始まり、
その後は主に、▲0.07～▲0.02%の水準で推移した。
調達一巡後もビットは底堅く、調整程度の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,564,000	2,564,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/28 のオペ結果
	3/28(火)		3/29(水)		3/30(木)		3/31(金)		
券	▲300		▲600		+0		▲1,000		9:20
財政	+6,200		▲900		+10,000		+9,400		ノーオペ
過不足	+5,900		▲1,500		+10,000		+8,400		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									10:40
国債買現先									米ドル資金供給(3/30-4/6)
国債売現先									貸付利率 1.360% 550百万米ドル
共通担保(本店)									CP等買入(3/31-)
共通担保(全店)									▲0.037%按分(70.6%) 5,995億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲500		▲300	+1,000				+6,000	国債補完供給(3/28-3/29)
社債等買入				+700					▲0.500% 全取 2,160億
ETF買入		+600							12:50
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									13:00
貸出									ノーオペ
国債補完供給	+3,000	▲2,200	+2,200						13:50
米ドル供給用担保国債供給									国債補完供給(3/28-3/29)
成長基盤強化支援									▲0.500% 全取 10億
貸出増加支援									
当座預金増減	+6,800		+2,100		+10,000		+14,400		
当座預金残高	3,415,900		3,418,000		3,428,000		3,442,400		
準備預金残高	3,069,700								
積み終了先	2,566,600								
超過準備	2,566,600								
非準備先残高	346,200								
準備預金進捗率	99.5%								
平均	41.9%		予想込増減 +2,100		予想込増減 +10,000		予想込増減 +14,400		
乖離率	57.6%		当預見込 3,418,000		当預見込 3,428,000		当預見込 3,442,400		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,243,400
3/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 10,300
3/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	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	-0.045	-0.045
ビッド	-0.040	0.000
レボ	-0.035	-0.035
出来値	-	-

3/27 時点のマナターベース(単位:億円) 4,452,100

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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.047	-0.001	-	0.030	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.058	-0.042	-	-0.362	-0.230	-0.169	-0.145	-	-0.154	-0.198	-0.222

§ 3/29 オフアのオペと市場動向予想

足許は▲0.075～+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。

3/29 の予定(国内)

なし

3/29 の予定(海外)

米 週間MBA住宅ローン申請指数
ホスト連銀総裁の講演
独 シゴ連銀総裁の講演(フランクフルト)

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	+2,100	3,418,000	+3,418,000	-0.075	-0.030	-0.030	-0.030	-0.030	-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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2017/3/27 ~ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	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				
2017/3/21 ~ 2017/4/3	8,000	3,050	3,050	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				
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	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 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	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				
2017/3/6 ~ 2017/3/21	8,000	1,465	1,465	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2017/2/27 ~ 2017/3/13	8,000	1,370	1,370	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2017/2/20 ~ 2017/3/6	8,000	1,516	1,516	0.00%	固定金利	-	札割れ	3/30 ~ 4/6	担保範囲内	550	550	1.360%	固定金利	0.0%	1.00				
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				

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