

DAILY SIGNAL

平成29年3月31日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/31 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは259兆5000億円だった。
本日未初物となる無担ON物は▲0.075%の出合から始まり▲0.085～▲0.03%のレンジで推移した。
一部年度未越えの資金調達を控える金融機関が見られ、前日対比低水準の地合であった。
同金利の加重平均は▲0.06%と昨年9月30日以来、約6ヵ月ぶりの低水準をつけた。
また、国債補充供給オペの落札額は23,286億円と過去最高を更新した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,595,000	2,595,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/31 のオペ結果
	3/31(金)		4/3(月)		4/4(火)		4/5(水)		
券	▲300		+1,300		+1,000		+0		9:20
財政	+6,600		▲3,700		▲8,000		+2,000		ノーオペ
過不足	+6,300		▲2,400		▲7,000		+2,000		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(4/4-)
国債買入		+11,400				+11,300			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.013%按分(67.7%) 3,007億
国債買現先				+10,000					(残存3年超5年以下)
国債売現先									+0.008%按分(83.6%) 3,805億
共通担保(本店)									(残存5年超10年以下)
共通担保(全店)			▲3,100	+3,000					+0.006%按分(67.4%) 4,507億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲8,100	+6,000	▲200						国債補充供給(3/31-4/3)
社債等買入									▲0.500% 全取 23,286億
ETF買入		+300							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
国債補充供給	+4,800	▲24,200	+24,200						13:50
米ドル供給用担保国債供給									国債補充供給(3/31-4/3)
成長基盤強化支援									▲0.500% 全取 229億
貸出増加支援	▲300								
当座預金増減	▲3,800		+31,500		+4,300		+2,000		
当座預金残高	3,428,200		3,459,700		3,464,000		3,466,000		
準備預金残高	3,075,600								
積み終了先	2,566,500								
超過準備	2,564,800								
非準備先残高	352,600								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	58.1%		予想込増減 +31,500		予想込増減 +4,300		予想込増減 +2,000		
乖離率	41.8%		当預見込 3,459,700		当預見込 3,464,000		当預見込 3,466,000		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,250.300
4/3 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 1,500
4/3 以降の残り積み立て額(残り所要)平均) 100

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

3/30 時点のマナターベース(単位:億円) 4,476,800

(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
3/23	672 (3M)	-0.3166%	-0.3398%
3/15	671 (3M)	-0.3039%	-0.3217%
3/14	670 (1Y)	-0.2500%	-0.2839%

3/30 のコール市場残高(前日比)		
合計	94,778	-434
有担	19,453	+65
無担	75,325	-499

*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	-0.086	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.060	0.000	-	-0.023	-0.015	-	0.002	-	-	-	-
東京レボレート	-0.520	-0.057	-	-0.093	-0.101	-0.107	-0.114	-	-0.148	-0.196	-0.216

§ 4/3 オファのオペと市場動向予想

足許は▲0.080～+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。

4/3 の予定(国内)

8:50 3月調査の短観・概要(日銀)

4/3 の予定(海外)

米 3月のISM製造業指数
フィラデルフィア連銀総裁の講演
リッチモンド連銀総裁の講演

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	+31,500	3,459,700	+3,459,700	-0.080	-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
2017/4/3 ~ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	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
2017/3/27 ~ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	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
2017/3/21 ~ 2017/4/3	8,000	3,050	3,050	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
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	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 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2017/3/6 ~ 2017/3/21	8,000	1,465	1,465	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
2017/2/27 ~ 2017/3/13	8,000	1,370	1,370	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
2017/2/20 ~ 2017/3/6	8,000	1,516	1,516	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