

DAILY SIGNAL

平成29年4月4日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/4 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは259兆8000億円だった。
本日の無担ON物は▲0.05%の出合から始まり、その後は▲0.075%～▲0.03%の幅広いレンジで取引された。調達一巡後はビッドレートが低下し、後場に入って▲0.08%近辺で出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,598,000	2,598,000

(単位:億円)

	日銀速報 4/4(火)		日銀予想 4/5(水)		当社需給予想 4/6(木) 4/7(金)				4/4 のオペ結果 9:20 ノーオペ 10:10 ノーオペ 10:40 米ドル資金供給(4/6-4/13) 貸付利率1.400% 0百万米ドル 11:50 国債補完供給(4/4-4/5) ▲0.600% 全取 2,915億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
券	+900		+800		+0		▲1,000		
財政	▲9,900		+5,800		▲24,000		+1,000		
過不足	▲9,000		+6,600		▲24,000		+0		
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		+11,400		+4,100					
国庫短期証券買入									
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入			▲300						
社債等買入									
ETF買入				+700					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+2,800	▲3,000	+3,000						
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	+2,200		+14,100		▲24,000		+0		
当座預金残高	3,460,900		3,475,000		3,451,000		3,451,000		
準備預金残高	3,092,800		共通担保オペ当社予想						
積み終了先	2,591,000		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		
超過準備	2,591,000								
非準備預金残高	368,100								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	64.5%		予想込増減 +14,100		予想込増減 ▲24,000		予想込増減 +0		
乖離率	35.4%		当預見込 3,475,000		当預見込 3,451,000		当預見込 3,451,000		
	</								

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,250,200
4/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,200
4/5 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	-0.050
ビッド	-0.040	-	0.000	-0.030
出来値	-	-	-	-

4/3 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,502,400

(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
4/4	673 (3M)	-0.1389%	-0.1612%
3/23	672 (3M)	-0.3166%	-0.3398%
3/15	671 (3M)	-0.3039%	-0.3217%

4/3 のコール市場残高(前日比)			
合計	85,907	+36,053	
有担	19,983	+11,329	
無担	65,924	+24,724	

*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	-0.025	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.003	-0.010	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.056	-0.010	-	-0.020	-0.022	-	0.001	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.054	-0.049	-	-0.084	-0.094	-0.100	-0.110	-	-0.149	-0.195	-0.216

§ 4/5 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。

4/5 の予定(国内)

8:50 4月の当座預金増減要因見込み(日銀)

4/5 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
3月のADP雇用統計
3月14～15日のFOMC議事録

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	+14,100	3,475,000	+3,475,000	-0.080	-0.030	-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		
2017/4/3 ～ 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	按分レート	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			4/6 ～ 4/13	担保範囲内	0	0	1.400%	固定金利	0.0%	応札なし		
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		

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