

# DAILY SIGNAL

平成29年4月6日(木)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 4/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは259兆6000億円だった。  
無担ON物は▲0.045%の出合から始まり、その後は▲0.05%~▲0.03%のレンジで推移した。  
資金調達ニーズは強く、同金利の加重平均は前日対比+0.01%の▲0.042%となった。  
後場には一部▲0.08%近辺での取引が見られ、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	-	-	2,596,000	2,596,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/6 のオペ結果
	4/6(木)		4/7(金)		4/10(月)		4/11(火)		
券	+500		+200		+1,000		+1,000		9:20 ノオベ
財政	▲17,700		+4,900		▲36,000		+2,000		10:10 ノオベ
過不足	▲17,200		+5,100		▲35,000		+3,000		11:50 ノオベ
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	12:50 ノオベ
国債買入				+11,500					13:00 ノオベ
国庫短期証券買入									共通担保(全店) 7.260
国債買現先									国債買現先 0
国債売現先									CP買現先 0
共通担保(本店)					▲3,900	+1,600			成長基盤強化 81,054
共通担保(全店)						+3,500			被災地金融機関支援 5,251
CP買現先									ロンバート残高 0
CP等買入	▲100		▲300						
社債等買入									
ETF買入		+100		+900					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+1,900	▲1,800	+1,800						
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	▲17,100		+19,000		▲33,800		+3,000		
当座預金残高	3,456,100		3,475,100		3,441,300		3,444,300		
準備預金残高	3,102,100		3,102,100		3,102,100		3,102,100		
積み終了先	2,603,100		2,603,100		2,603,100		2,603,100		
超過準備	2,603,100		2,603,100		2,603,100		2,603,100		
非準備先残高	354,000		354,000		354,000		354,000		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	71.0%		71.0%		71.0%		71.0%		
乖離率	28.9%		28.9%		28.9%		28.9%		
共通担保オベ当社予想	ノオベ		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
予想込増減	+19,000		+19,000		▲33,800		+3,000		
当預見込	3,475,100		3,475,100		3,441,300		3,444,300		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,250,200  
4/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 800  
4/7 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	-0.040	-0.100
レボ	-0.030	-0.030
ビッド	-0.050	0.000
レボ	-0.020	-0.020
出来値	-	-

4/5 時点のマナターベース(単位:億円) 4,515,100

(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
4/6	675 (3M)	-0.1303%	-0.1431%
4/5	674 (6M)	-0.1435%	-0.1494%
4/4	673 (3M)	-0.1389%	-0.1612%

4/5 のコール市場残高(前日比)			
合計	90,755	+2,919	
有担	19,258	-163	
無担	71,497	+3,082	

\*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	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.013	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.042	0.000	-	-0.015	-	-	0.005	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.044	-0.031	-	-0.071	-0.082	-0.094	-0.102	-	-0.142	-0.192	-0.212

## § 4/7 オファー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。  
共通担保オベは見送られると予想。

## 4/7 の予定(国内)

9:00 2月の毎月勤労統計速報(厚労省)  
10:00 3月31日現在の営業毎旬報告(日銀)  
14:00 2月の景気動向指数速報(内閣府)

## 4/7 の予定(海外)

米 3月の雇用統計  
欧 ユーロ圏財務相会合(マルタ)

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	+19,000	3,475,100	+3,475,100	-0.075	-0.040	-0.035	-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
2017/4/10 ~ 2017/4/24	8,000	1,600	1,600	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
2017/4/3 ~ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	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
2017/3/27 ~ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	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
2017/3/21 ~ 2017/4/3	8,000	3,050	3,050	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
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ							
2017/3/6 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	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
2017/3/6 ~ 2017/3/21	8,000	1,465	1,465	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
2017/2/27 ~ 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

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