

DAILY SIGNAL

平成29年4月7日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは262兆8000億円だった。
本日の無担ON物は▲0.035%の出合から始まった。週末要因から昨日以上に強含む展開となり、▲0.045～▲0.02%の水準で推移した。調達一巡後も堅調な地合は変わらず、後場に入って調整程度の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	-	-	2,628,000	2,628,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/7 のオペ結果
	4/7(金)		4/10(月)		4/11(火)		4/12(水)		
券	+300		+1,400		+1,000		+0		9:20
財政	+5,800		▲34,400		+2,000		▲1,000		ノーオペ
過不足	+6,100		▲33,000		+3,000		▲1,000		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	国庫短期証券買入(4/11-)
国債買入		+11,500							+0.016%按分(28.5%) 20,000億
国庫短期証券買入						+9,600			国債買入(4/11-)
国債買現先						+20,000			(残存1年超3年以下)
国債売現先									▲0.017%按分(42.7%) 2,806億
共通担保(本店)			▲3,900	+1,600					(残存3年超5年以下)
共通担保(全店)									▲0.018%按分(26.1%) 3,804億
CP買現先									(残存10年超25年以下)
CP等買入	▲300		▲100	+3,500					▲0.010%按分(30.0%) 2,003億
社債等買入									(残存25年超)
ETF買入		+900		+400					▲0.017%按分(61.0%) 1,002億
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(4/7-4/10)
貸出									▲0.500% 全取 1,896億
国債補完供給	+1,800	▲2,000	+2,000						12:50
米ドル供給用担保国債供給									ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノーオペ
									13:50
当座預金増減	+18,000		▲29,500		+32,600		▲1,000		国債補完供給(4/7-4/10)
当座預金残高	3,474,100		3,444,600		3,477,200		3,476,200		▲0.500% 全取 43億
準備預金残高	3,120,200		2,622,200		2,622,200		2,622,200		共通担保オペ当社予想
積み終了先	2,622,200		2,622,200		2,622,200		2,622,200		ノーオペ
超過準備	2,622,200		2,622,200		2,622,200		2,622,200		ノーオペ
非準備先残高	353,900		353,900		353,900		353,900		ノーオペ
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		共通担保(全店) 7,260
平均	80.6%		80.6%		80.6%		80.6%		国債買現先 0
乖離率	19.3%		19.3%		19.3%		19.3%		CP買現先 0
									成長基盤強化 81,054
									被災地金融機関支援 5,251
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,262,700
4/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 400
4/10 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	-0.050	-0.020
出来値	-	-

4/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,497,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	3/31
長期国債	282	361	377
CP等	2.2	2.3	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	12.9
J-REIT	0.27	0.36	0.38
貸出支援基金	31	41	46
国庫短期証券	43	50	41
その他とも資産計	383	476	490
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	343
その他とも負債・純資産計	383	476	490

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%

4/6 のコール市場残高(前日比)		
合計	97,469	+6,714
有担	19,592	+334
無担	77,877	+6,380

*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	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.002	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.035	-0.010	-	-0.018	-	-	0.005	-	-	-	-
東京レボレート	-0.034	-0.020	-	-0.069	-0.083	-0.095	-0.102	-	-0.139	-0.193	-0.212

§ 4/10 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。
共通担保オペは見送られると予想。

4/10 の予定(国内)

日銀支店長会議
8:50 3月の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)
14:00 地域経済報告(日銀)

4/10 の予定(海外)

米 FRBの3月の労働市場情勢指数

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	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	-29,500	3,444,600	+3,444,600	-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	米ドル資金供給オペ							
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