

DAILY SIGNAL

平成29年4月11日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/11 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは262兆2000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まった。
その後は▲0.05~▲0.03%のレンジで出合が見られた。
後場に入ると▲0.02%で調整程度の出合が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,622,000	2,622,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/11 のオペ結果
	4/11(火)		4/12(水)		4/13(木)		4/14(金)		
券	+1,000		+600		+0		▲1,000		9:20
財政	+1,000		+1,400		▲4,000		+78,000		ノオベ
過不足	+2,000		+2,000		▲4,000		+77,000		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	ノオベ
国債買入		+10,100							10:40
国庫短期証券買入		+20,000							米ドル資金供給(4/13-4/20)
国債買現先									貸付利率1.400% 0百万米ドル
国債売現先									11:50
共通担保(本店)									国債補完供給(4/11-4/12)
共通担保(全店)									▲0.500% 全取 1,716億
CP買現先	▲200		▲200						12:50
CP等買入									ノオベ
社債等買入									13:00
ETF買入		+200							ノオベ
J-REIT買入									13:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(4/11-4/12)
貸出									▲0.500% 全取 85億
国債補完供給	+1,800	▲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	+32,100		+3,600		▲4,000		+77,000		
当座預金残高	3,475,300		3,478,900		3,474,900		3,551,900		
準備預金残高	3,108,900								
積み終了先	2,616,300								共通担保オベ当社予想
超過準備	2,616,300								ノオベ
非準備先残高	366,400								ノオベ
準備預金進捗率	99.9%								ノオベ
平均	87.1%		予想込増減 +3,600		予想込増減 ▲4,000		予想込増減 +77,000		共通担保(全店) 4,960
乖離率	12.8%		当預見込 3,478,900		当預見込 3,474,900		当預見込 3,551,900		国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 81,054
									被災地金融機関支援 5,251
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,262,700
4/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
4/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	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	-0.015
ビッド	-0.050	0.000
出来値	-	-

4/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,482,900

(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%

4/10 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	84,806	-10,135	+686
	20,394	-	+686
	64,412	-	-10,821

*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	-0.054	-	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.037	-0.015	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.027	-0.021	-	-0.068	-0.082	-0.094	-0.102	-	-0.135	-0.189	-0.211

§ 4/12 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。

4/12 の予定(国内)

10:00 日銀営業毎旬報告(4月10日現在)
17:00 日本銀行が保有する国債の銘柄別残高
日本銀行による国庫短期証券の銘柄別買入額

4/12 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
3月の財政収支
NATO事務総長とトランプ米大統領が会談

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	+3,600	3,478,900	+3,478,900	-0.075	-0.030	-0.030	-0.030	-0.030	-0.010	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2017/4/10 ~ 2017/4/24	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/4/3 ~ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/3/27 ~ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/3/21 ~ 2017/4/3	8,000	3,050	3,050	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/3/6 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/3/6 ~ 2017/3/21	8,000	1,465	1,465	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/2/27 ~ 2017/3/13	8,000	1,370	1,370	0.00%	固定金利	- 札割れ

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	- 札割れ
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	- 札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7% 1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0% 2.70
米ドル資金供給オベ						
期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
4/13 ~ 4/20	担保範囲内	0	0	1.400%	固定金利	0.0% 応札なし
4/6 ~ 4/13	担保範囲内	0	0	1.400%	固定金利	0.0% 応札なし

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