

DAILY SIGNAL

平成29年4月12日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/12 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%の出合からスタート。
その後は▲0.05~▲0.035%のレンジで出合が見られた。
後場では▲0.035%で調整程度の出合が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	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				4/12 のオペ結果
	4/12(水)		4/13(木)		4/14(金)		4/17(月)		
券	+600		▲800		▲1,000		+0		9:20
財政	+2,500		+2,100		+78,000		▲21,000		ノーオペ
過不足	+3,100		+1,300		+77,000		▲21,000		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(4/14-)
国債買入									(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入						+10,800			▲0.008%按分(65.7%) 2,808億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
国債売現先									▲0.009%按分(98.9%) 3,507億
共通担保(本店)									(残存5年超10年以下)
共通担保(全店)									▲0.013%按分(53.0%) 4,508億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲200		▲300						国債補完供給(4/12-4/13)
社債等買入							▲3,000		▲0.500% 全取 1,811億
ETF買入									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
国債補完供給	+1,800	▲1,900	+1,900						13:50
米ドル供給用担保国債供給									国債補完供給(4/12-4/13)
成長基盤強化支援									▲0.500% 全取 44億
貸出増加支援									
当座預金増減	+2,800		+2,900		+87,800		▲24,000		
当座預金残高	3,478,100		3,481,000		3,568,800		3,544,800		
準備預金残高	3,116,100								
積み終了先			ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 4,960
超過準備	2,623,300								国債買現先 0
非準備先残高	362,000								CP買現先 0
準備預金進捗率	100.0%								成長基盤強化 81,054
平均	90.3%		予想込増減 +2,900		予想込増減 +87,800		予想込増減 ▲16,000		被災地金融機関支援 5,251
乖離率	9.7%		当預見込 3,481,000		当預見込 3,568,800		当預見込 3,552,800		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,262,700
4/13以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
4/13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	-0.030	-0.100
レボ	-0.050	-0.045
ビッド	-0.050	0.000
出来値	-	-

4/11 時点のマネターベース(単位:億円) 4,513,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	4/10
長期国債	282	361	380
CP等	2.2	2.3	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	13.2
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	37
その他とも資産計	383	476	490
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	344
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%

4/11 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	83,029	-1,777	-284
	20,110	-284	-
	62,919	-1,493	-

*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	-0.060	-	-	-	-0.023	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-0.015	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.036	-0.015	-	-	-0.019	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.024	-0.019	-	-0.069	-0.081	-0.094	-0.101	-	-0.133	-0.187	-0.211

§ 4/13 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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

4/13 の予定(国内)

8:50 前週の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

4/13 の予定(海外)

米 3月の生産者物価
週間の新規失業保険申請件数
4月のシカン大消費者信頼感(速報)

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	+2,900	3,481,000	+3,481,000	-0.075	-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
2017/4/10 ~ 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	4/13 ~ 4/20	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	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