DAILY SIGNAL

平成29年4月17日(月)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 4/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは267兆2000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.045%の出合からスタートし、
▲0.07～▲0.02%のレンジで出合が見られた。
積み初日ということもあり、調達意欲は限定的となり、
加重平均金利は▲0.054%と前日対比で0.007%低下した。

	即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
8:00	－	－	2,672,000	2,672,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想			
	4/17(月)		4/18(火)		4/19(水)		4/20(木)	
券		+700		▲100		▲1,000		▲2,000
財政		▲19,400		+1,700		+1,000		▲33,000
過不足		▲18,700		+1,600		+0		▲35,000
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				+10,000		+5,500		
国庫短期証券買入				+15,000				
国債買現先								
国債売現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)	▲3,000	+2,700						
CP買現先								
CP等買入	▲500		▲100			+3,500		
社債等買入	▲100		▲300					
ETF買入		+300						
J－REIT買入								
被災地金融機関支援								
貸出								
国債補完供給	+3,500	▲9,000	+9,000					
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		▲24,800		+35,200		+9,000		▲35,000
当座預金残高		3,543,600		3,578,800		3,587,800		3,552,800
準備預金残高		3,172,200	共通担保オペ当社予想					
積み終了先		2,548,100	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ	
超過準備		2,433,500						
非準預先残高		371,400						
準備預金進捗率		94.7%						
平均		6.7%	予想込増減	+35,200	予想込増減	+9,000	予想込増減	▲35,000
乖離率		88.0%	当預見込	3,578,800	当預見込	3,587,800	当預見込	3,552,800

4/17 のオペ結果

9:20
ノーオペ
10:10
国債買入(4/19-)
(残存5年超10年以下)
▲0.005%按分(60.7%) 4,510億
(変動利付債)
▲0.220円按分(59.2%) 1,001億
11:50
国債補完供給(4/17-4/18)
▲0.500% 全取 7,906億
12:50
ノーオペ
13:00
ノーオペ
13:50
国債補完供給(4/17-4/18)
▲0.500% 全取 865億

共通担保(全店)	4,630
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
ロンバート残高	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,220,900
4/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 117,400
4/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 4,200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オファー	-0.030	－	-0.100	-0.105
ビッド	-0.055	－	0.000	-0.095
出来値	－	－	－	－

4/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,608,400

(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
4/13	676 (3M)	-0.1070%	-0.1213%
4/6	675 (3M)	-0.1303%	-0.1431%
4/5	674 (6M)	-0.1435%	-0.1494%

4/14 のコール市場残高(前日比)

合計	90,109	+2,313
有担	19,391	+201
無担	70,718	+2,112

*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	-0.070	-0.070	－	-0.033	-0.030	－	－	－	－	－	－
最高	0.001	-0.015	－	0.230	-0.025	－	－	－	－	－	－
加重平均	-0.054	-0.060	－	-0.018	-0.027	-0.013	-0.020	－	－	－	－
東京レポ・レート	-0.082	-0.094	－	-0.100	-0.105	-0.110	-0.114	－	-0.130	-0.186	-0.211

§ 4/18 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。
共通担保オペはノーオペ予想。

4/18 の予定(国内)
特になし

4/18 の予定(海外)
米 住宅着工件数(3月)
鉱工業生産(3月)

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	+35,200	3,578,800	+3,578,800		-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) *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
2017/4/17 ～ 2017/5/1	8,000	2,650	2,650	0.00%	固定金利	－	札割れ
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

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
* 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

米ドル資金供給オペ

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
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