

DAILY SIGNAL

平成29年4月18日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは270兆1000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合からスタートし、
▲0.07~▲0.025%のレンジで出合が見られた。
調達一巡後も地合に変化はなくそのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,701,000	2,701,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/18 のオペ結果
	4/18(火)		4/19(水)		4/20(木)		4/21(金)		
券	▲100		▲600		▲2,000		▲3,000		9:20
財政	+2,100		+3,800		▲33,000		+0		ノオベ
過不足	+2,000		+3,200		▲35,000		▲3,000		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		+10,000		+5,600					10:40
国庫短期証券買入		+15,000							米ドル資金供給(4/20-4/27)
国債買現先									貸付利率1.410% 0百万米ドル
国債売現先									社債等買入(4/24-)
共通担保(本店)									▲0.009%按分(35.2%) 751億
共通担保(全店)									11:50
CP買現先			▲300	+3,500					国債補完供給(4/18-4/19)
CP等買入	▲100								▲0.600% 全取 9,207億
社債等買入	▲300								12:50
ETF買入				+500					ノオベ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノオベ
貸出									13:50
国債補完供給	+9,000	▲9,400	+9,400				▲1,100	+1,100	国債補完供給(4/18-4/19)
米ドル供給用担保国債供給									▲0.600% 全取 42億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+26,200		+21,900		▲35,000		▲3,000		
当座預金残高	3,569,800		3,591,700		3,556,700		3,553,700		
準備預金残高	3,199,200								
積み終了先	2,661,500								共通担保オベ当社予想
超過準備	2,616,400								ノオベ
非準備先残高	370,600								ノオベ
準備預金進捗率	98.0%								ノオベ
平均	10.0%		予想込増減 +21,900		予想込増減 ▲35,000		予想込増減 ▲3,000		共通担保(全店) 4,630
乖離率	88.0%		当預見込 3,591,700		当預見込 3,556,700		当預見込 3,553,700		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) 2,220,900
4/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 44,300
4/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,600

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先 レボG.C
オファー	-0.030	-
ビッド	-0.050	-
出来値	-	-

4/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,583,000

(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
4/18	677 (1Y)	-0.1537%	-0.1677%
4/13	676 (3M)	-0.1070%	-0.1213%
4/6	675 (3M)	-0.1303%	-0.1431%

4/17 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	93,896	20,499	73,447
	+3,787	+1,108	+2,729

*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	-	-0.030	-	-	-0.035	-	-	-	-
最高	0.010	-0.005	-	-0.010	-	-	-0.020	-	-	-	-
加重平均	-0.053	-0.057	-	-0.028	-0.020	-	-0.030	-	-	-	-
東京レボレート	-0.087	-0.096	-	-0.104	-0.114	-0.114	-0.118	-	-0.131	-0.186	-0.211

§ 4/19 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.07~+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オベはノオベ予想。

4/19 の予定(国内)

16:00 金融システムレポート(日銀、2017年4月号)

4/19 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
ページブック

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	+21,900	3,591,700	+3,591,700	-0.070	-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				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
2017/4/17 ~ 2017/5/1	8,000	2,650	2,650	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
2017/4/10 ~ 2017/4/24	8,000	1,600	1,600	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
2017/4/3 ~ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	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
2017/3/27 ~ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	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
2017/3/21 ~ 2017/4/3	8,000	3,050	3,050	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ							
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	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 ~ 2017/6/12	5,000	170	170	0.00%	固定金利	-	札割れ	4/20 ~ 4/27	担保範囲内	0	0	1.410%	固定金利	0.0%	応札なし
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

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