

DAILY SIGNAL

平成29年4月20日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは266兆9000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.05%の出から始まり、その後は
▲0.075～▲0.03%のレンジで取引された。
同加重平均金利は2日連続で低下し、▲0.061%(前日比▲0.005%)となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,669,000	2,669,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/20 のオペ結果
	4/20(木)		4/21(金)		4/24(月)		4/25(火)		
券	▲2,100		▲1,500		▲1,000		▲2,000		9:20
財政	▲36,300		+8,400		▲17,000		+13,000		ノーオペ
過不足	▲38,400		+6,900		▲18,000		+11,000		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	ノーオペ
国債買入				+11,000					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(4/20-4/21)
国債買現先									▲0.600% 全取 1,705億
国債売現先									12:50
共通担保(本店)					▲1,800	+1,800			ノーオペ
共通担保(全店)									13:00
CP買現先									共通担保(全店)(固定金利)
CP等買入	▲300		▲200						(4/24-5/8)
社債等買入	▲100					+800			0% 全取 1,540億
ETF買入		+600							共通担保(全店)(固定金利)
J-REIT買入									(4/24-7/31)
被災地金融機関支援			▲1,100	+1,100					0% 全取 220億
貸出									
国債補完供給	+9,200	▲1,700	+1,700						
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	▲30,700		+19,400		▲17,200		+11,000		
当座預金残高	3,552,700		3,572,100		3,554,900		3,565,900		
準備預金残高	3,172,700								
積み終了先	2,661,100		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 4,630
超過準備	2,656,200								国債買現先 0
非準備先残高	380,000								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.2%								成長基盤強化 81,054
平均	16.7%		予想込増減	+19,400	予想込増減	▲17,200	予想込増減	+11,000	被災地金融機関支援 5,251
乖離率	82.5%		当預見込	3,572,100	当預見込	3,554,900	当預見込	3,565,900	ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,220.900
4/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 18,000
4/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 700

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.020	-
レボ	-0.065	-
ビッド	-0.065	-
出来値	-	-

4/19 時点のマナターベース(単位:億円) 4,623,500

(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
4/20	678 (3M)	-0.1343%	-0.1427%
4/18	677 (1Y)	-0.1537%	-0.1677%
4/13	676 (3M)	-0.1070%	-0.1213%

4/19 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	91,720	-3,779	
有担	19,554	-986	
無担	72,166	-2,793	

*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	-0.075	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.035	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.061	-0.072	-	-0.034	-0.030	-0.050	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.090	-0.099	-	-0.116	-0.120	-0.119	-0.122	-	-0.130	-0.181	-0.211

§ 4/21 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.08～+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。

4/21 の予定(国内)

16:00 金融システムレポート別冊
(マクロ・ストレステストについて)

4/21 の予定(海外)

米 IMFと世銀の春季会合(ワシントン、23日まで)
3月の中古住宅販売件数
ミアホリス連銀総裁の講演

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	+19,400	3,572,100	+3,572,100	-0.080	-0.040	-0.040	-0.040	-0.035	-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				
2017/4/24 ~ 2017/5/8	8,000	1,540	1,540	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				
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	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				
2017/4/17 ~ 2017/5/1	8,000	2,650	2,650	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				
2017/4/10 ~ 2017/4/24	8,000	1,600	1,600	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				
2017/4/3 ~ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2017/3/27 ~ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	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				
2017/3/21 ~ 2017/4/3	8,000	3,050	3,050	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				
2017/3/13 ~ 2017/3/27	8,000	1,300	1,300	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