

DAILY SIGNAL

§ 4/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは265兆9000億円だった。

本日の無担保コールON物は▲0.07%の出会いから始まった。

その後、一部▲0.085%まで出合が見られ、昨日からさらに調達意欲が弱まる展開となった。同加重平均金利は4日連続で低下し、

▲0.07% (前日比 ▲0.004%) となり、2016年4月25日以来の低水準となった。

(単位: 億円)

平成29年4月24日(月)

上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備預金見込	所要対比
8:00	-	-	2,659,000	2,659,000

	日銀速報 4/24(月)		日銀予想 4/25(火)		当社需給予想				4/24 のオペ結果
	4/24(月)		4/25(火)		4/26(水)		4/27(木)		9:20
券	▲1,100		▲1,800		▲2,000		▲3,000		ノーオペ
財政	▲31,300		+4,600		+3,000		+3,000		10:10
過不足	▲32,400		+2,800		+1,000		+0		国債買入(4/26-)
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	(残存1年超3年以下)
国債買入				+4,000		+10,800			+0.008% 按分(5%) 2,807億
国庫短期証券買入				+10,000					(残存3年超5年以下)
国債買現先									+0.015% 按分(46.7%) 3,205億
国債売現先									(残存5年超10年以下)
共通担保(本店)									+0.007% 按分(80.1%) 4,503億
共通担保(全店)	▲1,800	+1,800							(物価連動債)
CP買現先									▲0.300円 全取 250億
CP等買入	▲500		▲400						11:50
社債等買入		+800	▲200						国債補完供給(4/24-4/25)
ETF買入		+700		+200					▲0.600% 全取 1,571億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+1,700	▲1,900	+1,900						ノーオペ
米ドル供給用担保国債供給									13:50
成長基盤強化支援									国債補完供給(4/24-4/25)
貸出増加支援									▲0.600% 全取 250億
当座預金増減	▲31,600		+18,300		+11,800		+0		
当座預金残高	3,536,500		3,554,800		3,566,600		3,566,600		
準備預金残高	3,168,400								共通担保保オベ当社予想
積み終了先	2,661,800		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 4,580
超過準備	2,661,700								国債買現先 0
非準備先残高	368,100								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.7%								成長基盤強化 81,054
平均	30.0%		予想込増減 +18,300		予想込増減 +11,800		予想込増減 +0		被災地金融機関支援 5,254
乖離率	69.7%		当預見込 3,554,800		当預見込 3,566,600		当預見込 3,566,600		ロンバード残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,220,900
 4/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,600
 4/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.050	-	-0.100	-0.105
ビッド	-0.080	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

4/21 時点のマネタリーベース(単位: 億円) 4,611,900

(参考) 日銀B/S(単位: 兆円)	15年末実績	16年末実績	4/20
長期国債	282	361	382
CP等	2.2	2.3	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	13.4
J-REIT	0.27	0.36	0.39
貸出支援基金	31	41	46
国庫短期証券	43	50	39
その他とも資産計	383	476	493
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	355
その他とも負債・純資産計	383	476	493

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%

4/21 のコール市場残高(前日比)

合計	95,810	-934
有担	20,280	+126
無担	75,529	-1,061

*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	-0.085	-	-	-0.050	-0.050	-	-	-	-	-	-
最高	0.010	-	-	-0.025	0.001	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.070	-0.030	-	-0.041	-0.042	-	0.000	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.090	-0.094	-	-0.121	-0.121	-0.120	-0.121	-	-0.132	-0.182	-0.211

§ 4/25 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.086~+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。

4/25 の予定(国内)

8:50 3月の企業向けサービス価格(日銀)

14:00 3月の実質輸出入の詳細(日銀)

4/25 の予定(海外)

米 3月の新築住宅販売件数

4月の消費者信頼感指数

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	+18,300	3,554,800	+3,554,800	-0.086	-0.060	-0.060	-0.060	-0.035	-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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	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	按分レート	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%	応れなし
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%	応れなし

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