

DAILY SIGNAL

平成29年4月26日(水)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは267兆4000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.07%の出しから始まった。
昨日に引き続き調達意欲は限定的で▲0.08%~▲0.086%の水準で主に取引が見られた。
同加重平均金利は6日連続で低下し、▲0.075%(前日対比▲0.001%)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	-	-	2,674,000	2,674,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/26 のオペ結果
	4/26(水)		4/27(木)		4/28(金)		5/1(月)		
券	▲2,800		▲3,200		▲3,900		▲1,000		9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(4/28-) (残存5年超10年以下) +0.005% 按分(55.2%) 4,508億 (残存10年超25年以下) +0.015% 按分(66.9%) 2,007億 (残存25年超) +0.018% 按分(79.3%) 1,005億 11:50 国債補完供給(4/26-4/27) ▲0.600% 全取 2,388億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
財政	+3,600		▲7,300		+2,300		▲11,000		
過不足	+800		▲10,500		▲1,600		▲12,000		
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		+10,900				+7,500			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲300			+3,500			
社債等買入			▲100						
ETF買入		+800		+700					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+2,500	▲2,400	+2,400						
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	+12,300		▲7,800		+9,400		▲14,700		
当座預金残高	3,565,900		3,558,100		3,567,500		3,552,800		
準備預金残高	3,180,300		3,180,300		3,180,300		3,180,300		
積み終了先	2,674,300		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		
超過準備	2,674,300		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 4,580		
非準備先残高	385,600		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先 0		
準備預金進捗率	99.7%		99.7%		99.7%		CP買現先 0		
平均	36.7%		36.7%		36.7%		成長基盤強化 81,054		
乖離率	63.1%		63.1%		63.1%		被災地金融機関支援 5,254		
			当預見込 3,558,100		当預見込 3,567,500		当預見込 3,560,800		
							ロンハート残高 0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,220,700
4/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,200
4/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	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	-0.115
ビッド	-0.086	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

4/25 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,600,400

(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
4/26	679 (3M)	-0.1383%	-0.1475%
4/20	678 (3M)	-0.1343%	-0.1427%
4/18	677 (1Y)	-0.1537%	-0.1677%

4/25 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	86,789	-2,630	+691
	66,654	-3,321	-

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特分含む。

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.086	-0.085	-	-0.060	-0.040	-	-0.080	-	-	-	-
最高	0.001	-0.030	-	-0.030	0.000	-	-0.060	-	-	-	-
加重平均	-0.075	-0.071	-	-0.042	-0.036	-	-0.072	-	0.100	-	-
東京レボ・レート	-0.095	-0.100	-	-0.146	-0.130	-0.125	-0.125	-	-0.131	-0.182	-0.211

§ 4/27 オファタ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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

4/27 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(2日目)
日銀展望レポート発表
黒田日銀総裁会見

4/27 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
3月の耐久財受注
欧 ECB理事会、ドラギECB総裁会見

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	-7,800	3,558,100	+3,558,100	-0.086	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.050	-0.030	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	*当日物		
						按分率	倍率	倍率
2017/4/24 ~ 2017/5/8	8,000	1,540	1,540	0.00%	固定金利	-	札割れ	
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ	
2017/4/17 ~ 2017/5/11	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	

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	*当日物		
						按分率	倍率	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	按分レト	平均レト	按分率	倍率	倍率
4/27 ~ 5/11	担保範囲内	0	0	1.360%	固定金利	0.0%	0.0%	応れなし
4/20 ~ 4/27	担保範囲内	0	0	1.410%	固定金利	0.0%	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。 上田八木証券株式会社 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