

DAILY SIGNAL

平成29年4月27日(木)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 4/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは266兆7000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.08%の出合からスタート。引き続き調達意欲は弱く、▲0.08%～▲0.086%での出合が目立ち、同加重平均金利は、▲0.075%(前日比▲0.001%)となった。
日銀は本日の決定会合で現状維持を決定。展望レポートでは17年度の成長率見通しを従来より引き上げる一方、コアCPI見通しを小幅下方修正した。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,667,000	2,667,000

	日銀速報 4/27(木)		日銀予想 4/28(金)		当社需給予想				4/27 のオペ結果
					5/1(月)		5/2(火)		
券	▲3,400		▲3,400		▲1,000		▲2,000		9:20 ノーオペ
財政	▲8,400		+5,100		▲11,000		▲10,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲11,800		+1,700		▲12,000		▲12,000		11:50 国債補完供給(4/27-4/28) ▲0.600% 全取 2,442億
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	12:50 ノーオペ
国債買入				+7,600					13:00 共通担保(全店)<固定金利> (5/1-5/15) 0% 全取 2,550億
国庫短期証券買入									13:50 国債補完供給(4/27-4/28) ▲0.600% 全取 64億
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)					▲2,700	+2,600			
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲1,500	+3,500					
社債等買入	▲100		▲200						
ETF買入		+700		+700					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+2,400	▲2,600	+2,600						
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	▲11,700		+14,400		▲12,100		▲12,000		
当座預金残高	3,554,200		3,568,600		3,556,500		3,544,500		
準備預金残高	3,170,400				共通担保オペ当社予想				
積み終了先	2,666,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 4,580
超過準備	2,666,400								国債買現先 0
非準備預金残高	383,800								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.7%								成長基盤強化 81,054
平均	40.0%		予想込増減 +14,400		予想込増減 ▲12,100		予想込増減 ▲12,000		被災地金融機関支援 5,254
乖離率	59.7%		当預見込 3,568,600		当預見込 3,556,500		当預見込 3,544,500		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,220.700
4/28 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 5,600
4/28 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	-0.105
ビッド	-0.086	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

4/26 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,615,600

(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%

4/26 のコール市場残高(前日比)			
合計	86,680	-109	
有担	19,441	-694	
無担	67,239	+585	

*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	-0.086	-0.082	-	-0.045	-0.045	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.040	-	-0.025	0.002	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.075	-0.074	-	-0.035	-0.025	-	-0.050	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.095	-0.097	-	-0.119	-0.119	-0.119	-0.121	-	-0.131	-0.182	-0.211

§ 4/28 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。
共通担保オペはノーオペ予想。

4/28 の予定(国内)

8:30 3月の完全失業率(総務省)
CPI(全国3月、東京都都区部2月)(総務省)
8:50 3月の鉱工業生産速報(経産省)

4/28 の予定(海外)

米 1～3月のGDP速報
フィラデルフィア連銀総裁講演
欧 4月のユーロ圏CPI速報

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	+14,400	3,568,600	+3,568,600	-0.086	-0.060	-0.060	-0.060	-0.050	-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)								*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	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					
2017/5/1 ~ 2017/5/15		8,000	2,550	2,550	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	2015/11/18 ~ 2015/11/19		1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ					
2017/4/24 ~ 2017/5/8		8,000	1,540	1,540	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	2012/6/1 ~ 2012/6/15		10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70					
2017/4/24 ~ 2017/7/31		5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ																						
2017/4/17 ~ 2017/5/1		8,000	2,650	2,650	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	4/27 ~ 5/11		担保範囲内	0	0	1.360%	固定金利	0.0%	応れなし					
2017/4/10 ~ 2017/4/24		8,000	1,600	1,600	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														
2017/4/3 ~ 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																							

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(登名)第 243号 加入協会 日本証券業協会