

DAILY SIGNAL

平成29年4月28日(金)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは269兆7000億円だった。
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限定的で、オファー残りの状況が見られた。
同加重平均金利は▲0.074%となり、週を通して低位で推移した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,697,000	2,697,000

(単位: 億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/28 のオペ結果
	4/28(金)		5/1(月)		5/2(火)		5/8(月)		
券	▲3,500		▲2,300		▲2,000		+4,000		9:20 ノオベ
財政	+4,100		▲9,300		▲10,000		▲34,000		10:10 国庫短期証券買入(5/2-)
過不足	+600		▲11,600		▲12,000		▲30,000		▲0.006% 按分(33.9%) 5,000億
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	11:50 国債補完供給(4/28-5/1)
国債買入		+7,600							▲0.600% 全取 2,285億
国庫短期証券買入						+5,000			12:50 ノオベ
国債買現先									13:00 ノオベ
国債売現先									13:50 国債補完供給(4/28-5/1)
共通担保(本店)			▲2,700	+2,600			▲1,500		▲0.600% 全取 62億
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲1,500	+3,500	▲300						
社債等買入	▲200								
ETF買入		+700							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+2,600	▲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	+10,900		▲9,600		▲7,000		▲31,500		
当座預金残高	3,565,100		3,555,500		3,548,500		3,517,000		
準備預金残高	3,182,500								
積み終了先	2,683,200		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 4,580
超過準備	2,683,200								国債買現先 0
非準備預金残高	382,600								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.8%		予想込増減 ▲9,600		予想込増減 ▲7,000		予想込増減 ▲23,500		成長基盤強化 81,054
平均	50.0%		当預見込 3,555,500		当預見込 3,548,500		当預見込 3,525,000		被災地金融機関支援 5,254
乖離率	49.8%								ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,221,800
5/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,600
5/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	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	-	-	-	-

(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	回数	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%

4/27 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	82,404	-642	-3,634
	82,404	-642	-3,634

4/27 時点のマネタリーベース(単位: 億円) 4,607,300

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	-	-	-0.058	-	-0.038	0.001	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.030	-	0.001	0.005	-	-	-	-
加重平均	-0.074	-0.040	-	-0.039	-0.040	-0.020	0.004	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.089	-0.092	-	-0.117	-0.119	-0.119	-0.120	-	-0.131	-0.182	-0.211

§ 5/1 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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

5/1 の予定(国内)

8:50 3月の都道府県別預金・現金・貸出金(日銀)
14:00 4月の新車販売(自販連)

5/1 の予定(海外)

3月の個人消費支出
4月の製造業PMI確報
4月のISM製造業指数

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
◎ ノオベ	-9,600	3,555,500	+3,555,500	-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	按分レト	平均レト	按分率	倍率	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
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
2017/4/24 ~ 2017/5/8	8,000	1,540	1,540	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
2017/4/24 ~ 2017/7/31	5,000	220	220	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
2017/4/17 ~ 2017/5/1	8,000	2,650	2,650	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
2017/4/10 ~ 2017/4/24	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2017/4/3 ~ 2017/4/17	8,000	2,980	2,980	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2017/3/27 ~ 2017/4/10	8,000	3,900	3,900	0.00%	固定金利	-	札割れ	4/27 ~ 5/11	担保範囲内	0	0	1.360%	固定金利	0.0%	応れなし
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

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