

DAILY SIGNAL

平成29年9月27日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは329兆4,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.04%の出合から始まり、その後は▲0.04~▲0.07%のレンジで取引された。後場にかけて▲0.07%台で調整程度の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,294,000	3,294,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/27 のオペ結果
	9/27(水)		9/28(木)		9/29(金)		10/2(月)		
券	▲600		▲1,300		▲1,000		+1,000		9:20 ノオベ
財政	▲8,900		▲8,800		+0		▲6,000		10:10 ノオベ
過不足	▲9,500		▲10,100		▲1,000		▲5,000		国債買入(9/29-) (残存1年超3年以下)
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3年超5年以下)
国債買入		+10,100				+8,800			▲0.001% 按分(19.5%)2,802億
国庫短期証券買入									(残存3年超5年以下)
国債買現先									+0.006% 按分(62.6%)3,005億
国債売現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									+0.004% 按分(52.3%)2,005億
共通担保(全店)							▲4,300		(残存25年超)
CP買現先									+0.004% 按分(8.4%)1,003億
CP等買入	▲800		▲400			+2,500			11:50
社債等買入									国債補完供給(9/27-9/28)
ETF買入		+500							▲0.500% 全取 22億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノオベ
貸出									13:00
国債補完供給	+400								ノオベ
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	+700		▲10,500		+10,300		▲9,300		
当座預金残高	3,714,900		3,704,400		3,714,700		3,705,400		
準備預金残高	3,291,900		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 7,026
積み終了先	3,291,200		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		国債買現先 0
超過準備	3,291,100		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		CP買現先 0
非準備先残高	423,000		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		成長基盤強化 92,686
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		被災地金融機関支援 5,235
平均	40.0%		40.0%		40.0%		40.0%		ロンハート残高 0
乖離率	59.6%		59.6%		59.6%		59.6%		
予想込増減	▲10,500		▲10,500		+10,300		▲1,300		
当預見込	3,704,400		3,704,400		3,714,700		3,713,400		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,911,600
9/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 11,900
9/28 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	-0.035	-	-0.100	-0.150
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.100
出来値	-	-	-	-

9/26 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,767,300**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	9/20
長期国債	282	361	402
CP等	2.2	2.3	2.5
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	6.9	11.1	15.7
J-REIT	0.27	0.36	0.43
貸出支援基金	31	41	48
国庫短期証券	43	50	30
その他とも資産計	383	476	510
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	370
その他とも負債・純資産計	383	476	510

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
9/20	710 (3M)	-0.1002%	-0.1074%
9/15	709 (1Y)	-0.1278%	-0.1308%
9/14	708 (3M)	-0.1175%	-0.1394%

9/26 のコール市場残高(前日比)

	合計	95,588	-3,702
有担	21,304	+610	
無担	74,284	-4,312	

*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	-0.078	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.074	-0.068	-	-0.134	-0.115	-0.111	-0.109	-	-0.112	-0.129	-0.152

9/28 オファタ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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

9/28 の予定(国内)

8:50 前週の対外及び対内証券売買契約等の状況
(財務省)

9/28 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
4~6月のGDP確報値

黒田日銀総裁、挨拶(全国証券大会)

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	▲10,500	3,704,400	+3,704,400	-0.080	-0.050	-0.050	-0.050	-0.045	-0.035	-0.030	-0.010	-0.010
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.080	0.100

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	*当日物		
					平均レト	按分率	倍率
2017/9/25 ~ 2017/10/10	8,000	2,386	2,386	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/19 ~ 2017/10/2	8,000	4,300	4,300	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/19 ~ 2017/12/25	5,000	120	120	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/11 ~ 2017/9/25	8,000	1,985	1,985	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/4 ~ 2017/9/19	8,000	1,360	1,360	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/28 ~ 2017/9/11	8,000	1,932	1,932	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/21 ~ 2017/9/4	8,000	1,451	1,451	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/14 ~ 2017/8/28	8,000	1,530	1,530	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	*当日物		
					平均レト	按分率	倍率
2017/5/24 ~ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	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
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
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
9/28 ~ 10/5	担保範囲内	400	400	1.630%	固定金利	0.0%	1.00
9/21 ~ 9/28	担保範囲内	2	2	1.660%	固定金利	0.0%	1.00

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