

DAILY SIGNAL

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

9/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは327兆8,000億円だった。
四半期末初物となる本日の無担保コールON物は▲0.06%の割合から始まり、
その後は▲0.05～▲0.075%のレンジで取引された。後場にかけて▲0.08%台で
調整程度の割合が散見されて引けた。
総務省が発表した8月の全国CPI(除く生鮮食品)は、前年同月比0.7%上昇した。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	3,278,000	3,278,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/29 のオペ結果
	9/29(金)		10/2(月)		10/3(火)		10/4(水)		
券	▲400		+700		+1,000		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲15,000		▲10,700		▲15,000		▲25,000		10:10 国庫短期証券買入(10/3-)
過不足	▲15,400		▲10,000		▲14,000		▲25,000		+0.001% 按分(39.7%)7,501億
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	国債買入(10/3-)
国債買入		+9,100				+7,100			(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入						+7,500			▲0.009% 按分(15%)4,106億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
国債売現先			▲4,300	+2,300					▲0.017% 按分(22.8%)2,003億
共通担保(本店)									(残存25年超)
共通担保(全店)									▲0.018% 按分(100%)1,001億
CP買現先	▲4,900	+2,500	▲400						11:50
CP等買入	▲100								国債補完供給(9/29-10/2)
社債等買入									▲0.500% 全取 3,772億
ETF買入									12:50
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									13:00
貸出									ノーオペ
国債補完供給		▲3,900	+3,900						13:50
米ドル供給用担保国債供給									国債補完供給(9/29-10/2)
成長基盤強化支援									▲0.500% 全取 40億
貸出増加支援									
当座預金増減	▲12,700		▲8,500		+600		▲25,000		
当座預金残高	3,691,700		3,683,200		3,683,800		3,658,800		
準備預金残高	3,274,400		3,273,600		3,273,600		3,273,600		
積み終了先	3,273,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 7,026
超過準備	3,272,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先 0
非準備先残高	417,300		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.8%		99.8%		99.8%		99.8%		成長基盤強化 92,686
平均	53.3%		53.3%		53.3%		53.3%		被災地金融機関支援 5,235
乖離率	46.5%		46.5%		46.5%		46.5%		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,913,100
10/2 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,800
10/2 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	-0.035	-0.100
レボG.C	-0.095	-0.095
ビッド	-0.065	0.000
レボG.C	-0.080	-0.080
出来値	-	-

9/28 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,759,400**

(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
9/28	711 (3M)	-0.1550%	-0.1652%
9/20	710 (3M)	-0.1002%	-0.1074%
9/15	709 (1Y)	-0.1278%	-0.1308%

9/28 のコール市場残高(前日比)

	9/28	9/27
合計	95,982	+1,175
有担	21,408	+1,132
無担	74,574	+1,043

*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	-	-	-0.045	-0.040	-	-0.035	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.035	-0.009	-	0.010	-	-	-	-
加重平均	-0.063	-	-	-0.038	-0.036	-	-0.016	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.126	-0.083	-	-0.098	-0.097	-0.099	-0.106	-	-0.120	-0.131	-0.153

10/2 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を予想。

10/2 の予定(国内)

8:50 9月調査の短観・概要(日銀)

10/2 の予定(海外)

米 9月のISM製造業指数
ダラス連銀総裁の講演

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	▲8,500	3,683,200	+3,683,200	-0.086	-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	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2017/10/2 ~ 2017/10/16	8,000	2,250	2,250	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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

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