

DAILY SIGNAL

平成29年10月2日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは325兆5,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.045%の出合から始まり、
その後は▲0.04~▲0.06%のレンジで取引された。
後場では▲0.07%台で調整程度の出合が散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,255,000	3,255,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/2 のオペ結果
	10/2(月)		10/3(火)		10/4(水)		10/5(木)		
券	+600		+300		+0		▲1,000		9:20
財政	▲13,100		▲7,300		▲25,000		+23,000		ノオベ
過不足	▲12,500		▲7,000		▲25,000		+22,000		10:10
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	ノオベ
国債買入				+7,200					11:50
国庫短期証券買入				+7,500					国債補完供給(10/2-10/3)
国債買現先									▲0.600% 全取 110億
国債売現先									12:50
共通担保(本店)									ノオベ
共通担保(全店)	▲4,300	+2,300							13:00
CP買現先									ノオベ
CP等買入	▲400		▲100						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+3,900	▲100	+100						
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	▲11,100		+7,700		▲25,000		+22,000		
当座預金残高	3,680,600		3,688,300		3,663,300		3,685,300		
準備預金残高	3,244,300		3,243,500		3,243,500		3,243,500		
積み終了先	3,243,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 4,976
超過準備	3,243,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0
非準備先残高	436,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化 92,686
平均	56.7%		56.7%		56.7%		56.7%		被災地金融機関支援 5,235
乖離率	43.2%		43.2%		43.2%		43.2%		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,913,100
10/3 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,900
10/3 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N	ユーロ円	T+2	CP現先	レボG.C
オファー	-0.035	-	-0.100	-0.150	-
ビッド	-0.065	-	0.000	-0.100	-
出来値	-	-	-	-	-

9/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,747,100**

(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%

9/29 のコール市場残高(前日比)

	合計	63,980	-32,002
有担	13,300	-8,108	
無担	50,680	-23,894	

*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	-	-	-0.035	-0.050	-	-0.040	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	0.022	-	0.000	-	-	-	-
加重平均	-0.047	-	-	-0.025	-0.034	-0.035	-0.027	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.090	-0.092	-	-0.099	-0.099	-0.101	-0.107	-	-0.119	-0.131	-0.153

§ 10/3 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.078~+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノオペを予想。

10/3 の予定(国内)

8:50 9月調査の短観全容・企業の物価見通し(日銀)
14:00 8月の基調的なインフレ率を補足するための指標(日銀)
15:00 9月の財政資金対民間収支の実績(財務省)

10/3 の予定(海外)

欧 8月の生産者物価

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	当残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオベ	+7,700	3,688,300	+3,688,300	-0.078	-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	平均レト	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	按分レト	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