

DAILY SIGNAL

平成29年10月3日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

S 10/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは326兆円だった。
無担保コールON物は▲0.04%の合出から始まり、その後は
▲0.035~▲0.07%のレンジで取引された。昨日より調達意欲が高まり、
同加重平均金利は▲0.043%と昨日対比0.4bp上昇した。

Table with 5 columns: 即日オペ種類, オファー額, 準備残高見込, 所要対比. Data row: 8:00, -, -, 3,260,000, 3,260,000

(単位:億円)

Main table with columns: 日銀速報, 日銀予想, 当社需給予想, 10/3 のオペ結果. Includes sub-tables for market movements and operations.

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,913,100
10/4 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 3,500
10/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

Table with columns: T/N, T+2, 無担, ユーロ円, CP現先, レボG.C. Data row: オファー -0.035, ビッド -0.065, 出来値 -

10/2 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,735,400

Table with columns: (参考)日銀B/S(単位:兆円), 15年末実績, 16年末実績, 9/20. Includes items like 長期国債, CP等, 社債等, etc.

T-Billの入札結果(直近3回)

Table with columns: 入札日, 回数, 最高利回, 平均利回. Data rows for 9/28, 9/20, 9/15.

10/2 のコール市場残高(前日比)

Table with columns: 合計, 有担, 無担. Data rows: 合計 95,852, 有担 21,551, 無担 74,301

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特別分含む。

Table with columns: 無担保コールレート速報, ON, TN, SN, 1W, 2W, 3W, 1M, 2M, 3M, 6M, 1Y. Data row: 最低 -0.070, 最高 0.001, 加重平均 -0.043

S 10/4 オファ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。
共通担保オペはノーオペを予想。

10/4 の予定(国内)

14:00 需給ギャップと潜在成長率(日銀)
8:50 日銀当座預金増減要因(10月見込み)

10/4 の予定(海外)

米 9月ADP雇用統計
9月ISM非製造業指数
FRB議長講演

Table with columns: 翌営業日の即日オペ予想, 翌営業日の出合いレンジ予想. Includes sub-tables for market expectations.

共通担保資金供給(全店)

Table with columns: 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. Data rows for 2017/10/2, 2017/9/25, etc.

共通担保資金供給(本店)

Table with columns: 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. Data rows for 2017/5/24, 2016/10/20, etc.

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。