

DAILY SIGNAL

平成29年10月13日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは329兆3,000億円だった。
積み最終日となる無担保コールON物は▲0.015%の出合からスタート。
その後も堅調な地合いが続き、主に▲0.04%~▲0.01%のレンジで出合が見られた。
後場では▲0.045%~▲0.02%で調整程度の出合が散見され引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	3,293,000	3,293,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/13 のオペ結果
	10/13(金)		10/16(月)		10/17(火)		10/18(水)		
券	▲200		+600		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ
財政	+63,900		▲18,600		▲3,000		+3,000		10:10 国庫短期証券買入(10/17-)
過不足	+63,700		▲18,000		▲3,000		+2,000		▲0.001% 按分(82.6%) 7,503億
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(10/13-10/16)
国債買入				+7,800					▲0.500% 全取 628億
国庫短期証券買入						+7,500			
国債買現先									12:50 ノーオペ
国債売現先									13:00 ノーオペ
共通担保(本店)			▲2,300	+1,400					
共通担保(全店)									
CP買現先			▲300						
CP等買入	▲600					+3,000			
社債等買入									
ETF買入		+700		+600					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給		▲700	+700						
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	+63,100		▲10,100		+7,500		+2,000		
当座預金残高	3,710,300		3,700,200		3,707,700		3,709,700		
準備預金残高	3,289,900		3,289,900		3,289,900		3,289,900		
積み終了先	3,289,900		3,289,900		3,289,900		3,289,900		共通担保(全店) 4,625
超過準備	3,289,800		3,289,800		3,289,800		3,289,800		国債買現先 0
非準備先残高	420,400		420,400		420,400		420,400		CP買現先 0
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		成長基盤強化 92,686
平均	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		被災地金融機関支援 5,235
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		ロンハート残高 0

来 積み期間の所要準備額(積数) 3,019,500
10/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,019,500
10/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 97,400

	T/N	T+2
無担 ユーロ円 CP現先 レボG.C		
オファー	-0.020	-0.100
ビッド	-0.040	0.000
出来値	-	-

10/12 時点のマネタリベース(単位:億円) **4,701,900**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	10/10
長期国債	282	361	407
CP等	2.2	2.3	1.8
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	15.9
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	513
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	361
その他とも負債・純資産計	383	476	513

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
10/12	714 (3M)	-0.1768%	-0.1865%
10/5	713 (3M)	-0.1617%	-0.1685%
10/4	712 (6M)	-0.1603%	-0.1643%

10/12 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	96,741	+697	
	20,559	-606	
	76,182	+1,303	

*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	-0.060	-	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.220	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.021	-	-	-0.030	-0.015	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.097	-0.098	-	-0.103	-0.103	-0.108	-0.110	-	-0.122	-0.131	-0.153

§ 10/16 オファ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。
共通担保オペはノーオペを予想。

10/16 の予定(国内)

13:30 8月の鉱工業生産確報(経産省)
17:00 9月の業態別の日銀当座預金残高(日銀)

10/16 の予定(海外)

米 10月のNY連銀製造業景況感指数

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
◎ ノーオペ	▲10,100	3,700,200	+3,700,200	-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	平均レト	按分率	倍率
2017/10/16 ~ 2017/10/30	8,000	1,350	1,350	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/10/10 ~ 2017/10/23	8,000	2,035	2,035	0.00%	固定金利	-	札割れ
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
2017/9/10 ~ 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

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
10/13 ~ 10/19	担保範囲内	0	0	1.660%	固定金利	0.0%	応れなし
10/5 ~ 10/13	担保範囲内	1	1	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