

DAILY SIGNAL

平成29年10月17日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/17 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。
無担保コールON物は▲0.040%の出合からスタート。
その後は▲0.055%～▲0.03%で出合が見られた。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06%台の出合も見られた。

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

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/17 のオペ結果
	10/17(火)		10/18(水)		10/19(木)		10/20(金)		
券	+200		▲200		▲1,000		▲2,000		9:20 ノーオペ
財政	▲5,700		+1,500		▲11,000		▲11,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲5,500		+1,300		▲12,000		▲13,000		10:40 ノーオペ
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 米ドル資金供給(10/19-10/26) 貸付利率 1.660% 2百万米ドル
国債買入				+10,000					11:50 国債補完供給(10/17-10/18) ▲0.500% 全取 78億
国庫短期証券買入		+7,500							12:50 ノーオペ
国債買現先									13:00 ノーオペ
国債売現先									13:50 ノーオペ
共通担保(本店)									13:50 国債補完供給(10/17-10/18) ▲0.500% 全取 33億
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲100	+3,000	▲100						
社債等買入									
ETF買入		+100							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援							▲200	+100	
貸出									
国債補完供給	+700	▲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	+5,600		+11,300		▲12,000		▲13,100		
当座預金残高	3,705,800		3,717,100		3,705,100		3,692,000		
準備預金残高	3,275,000		3,275,000		3,275,000		3,275,000		
積み終了先	3,159,700		3,159,700		3,159,700		3,159,700		
超過準備	2,839,000		2,839,000		2,839,000		2,839,000		
非準備先残高	430,800		430,800		430,800		430,800		
準備預金進捗率	95.2%		95.2%		95.2%		95.2%		
平均	6.5%		6.5%		6.5%		6.5%		
乖離率	88.8%		88.8%		88.8%		88.8%		
共通担保オペ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 3,725
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 92,686
									被災地金融機関支援 5,235
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,019,500
10/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 143,500
10/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 4,900

	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	-0.150	-0.150
ビッド	-0.045	0.000
レボ	-0.115	-0.115
出来値	-	-

(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%

10/16 のコール市場残高(前日比)

	合計	91,372	-5,972
有担	20,601	-756	
無担	70,771	-5,216	

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

10/16 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,754,400

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.065	-	-	-0.040	-0.038	-	-	-	-	-	-
最高	0.050	-	-	-0.025	0.018	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.043	-	-	-0.034	-0.010	-	-0.025	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.099	-0.162	-	-0.129	-0.124	-0.120	-0.119	-	-0.129	-0.134	-0.157

§ 10/18 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.07～+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。

10/18 の予定(国内)

櫻井日銀審議委員の挨拶(函館)

10/18 の予定(海外)

米 週間MBA住宅ローン申請指数

ペー・ジュップ

NY連銀総裁とダラス連銀総裁の討論会

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	+11,300	3,717,100	+3,717,100	-0.070	-0.045	-0.045	-0.045	-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
2017/10/16 ~ 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
2017/9/19 ~ 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

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	*当日物			
								オファー額	応札額	落札額	
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				
10/19 ~ 10/26	担保範囲内	2	2	1.660%	固定金利	0.0%	1.00				
10/13 ~ 10/19	担保範囲内	0	0	1.660%	固定金利	0.0%	札割れなし				

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