

DAILY SIGNAL

平成29年10月19日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/19 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは326兆6,000億円だった。
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～▲0.035%で出合が見られた。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.065%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	-	-	3,266,000	3,266,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/19 のオペ結果
	10/19(木)		10/20(金)		10/23(月)		10/24(火)		
券	▲1,000		▲1,100		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲8,400		▲14,600		▲21,000		+3,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲9,400		▲15,700		▲21,000		+3,000		10:40 社債等買入(10/25-) +0.016% 按分(43.3%) 1,001億
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(10/19-10/20) ▲0.500% 全取 263億
国債買入				+4,100					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入									13:00 共通担保(全店)<固定金利> (10/23-11/6) 0% 全取 1,630億
国債買現先					▲2,000	+1,600			13:50 国債補完供給(10/19-10/20) ▲0.500% 全取 142億
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲100								
CP買現先			▲400						
CP等買入	▲100								
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援			▲200	+100					
貸出									
国債補完供給	+400	▲400	+400						
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	▲9,600		▲11,700		▲21,400		+3,000		
当座預金残高	3,708,400		3,696,700		3,675,300		3,678,300		
準備預金残高	3,271,300		3,252,900		3,252,900		3,252,900		
積み終了先	3,252,900		3,252,900		3,252,900		3,252,900		共通担保(全店) 3,725
超過準備	3,244,800		3,244,800		3,244,800		3,244,800		国債買現先 0
非準備先残高	437,100		437,100		437,100		437,100		CP買現先 0
準備預金進捗率	98.8%		98.8%		98.8%		98.8%		成長基盤強化 92,686
平均	12.9%		12.9%		12.9%		12.9%		被災地金融機関支援 5,235
乖離率	85.9%		85.9%		85.9%		85.9%		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,019.500
10/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 35,700
10/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,300

	T/N	ユーロ円	T+2	CP現先	レボG.C
無担	-0.035	-	-0.100	-0.100	-
オファー	-0.035	-	-0.100	-0.100	-
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.090	-
出来値	-	-	-	-	-

10/18 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,772,200

(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
10/19	716 (3M)	-0.1861%	-0.1924%
10/18	715 (1Y)	-0.1618%	-0.1687%
10/12	714 (3M)	-0.1768%	-0.1865%

10/18 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
10/18	86,556	17,142	69,414
10/17	-3,505	-4,065	+560

*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	-0.065	-	-	-0.050	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.050	-	-	-0.028	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.042	-	-	-0.044	-0.040	-	-	-0.030	-	-	-
東京レボ・レート	-0.103	-0.098	-	-0.111	-0.113	-0.113	-0.115	-	-0.130	-0.136	-0.160

§ 10/20 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。

10/20 の予定(国内)

黒田日銀総裁挨拶(全国信用組大会)

10/20 の予定(海外)

米 11月FRB議長の講演
グループ「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	▲11,700	3,696,700	+3,696,700	-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)				*当日物				共通担保資金供給(本店)				*当日物			
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	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
2017/10/23 ~ 2017/11/6	8,000	1,630	1,630	0.00%	固定金利	-	札割れ	2017/5/24 ~ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	札割れ
2017/10/18 ~ 2017/10/19	1,000	51	51	0.00%	固定金利	-	札割れ	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ
2017/10/16 ~ 2017/10/30	8,000	1,350	1,350	0.00%	固定金利	-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2017/10/10 ~ 2017/10/23	8,000	2,035	2,035	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2017/10/2 ~ 2017/10/16	8,000	2,250	2,250	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2017/9/25 ~ 2017/10/10	8,000	2,386	2,386	0.00%	固定金利	-	札割れ	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
2017/9/19 ~ 2017/10/2	8,000	4,300	4,300	0.00%	固定金利	-	札割れ	10/19 ~ 10/26	担保範囲内	2	2	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
2017/9/19 ~ 2017/12/25	5,000	120	120	0.00%	固定金利	-	札割れ	10/13 ~ 10/19	担保範囲内	0	0	1.660%	固定金利	0.0%	応札なし

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