

DAILY SIGNAL

平成29年10月23日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは325兆2,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.04%の出合からスタート。
その後は、▲0.055～▲0.035%の水準で取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06%台の出合が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,252,000	3,252,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/23 のオペ結果
	10/23(月)		10/24(火)		10/25(水)		10/26(木)		
券	▲100		▲700		▲1,000		▲1,000		9:20 ノオペ
財政	▲20,300		▲3,400		+3,000		▲3,000		10:10 ノオペ
過不足	▲20,400		▲4,100		+2,000		▲4,000		11:50 ノオペ
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	12:50 ノオペ
国債買入				+10,000					13:00 ノオペ
国庫短期証券買入				+5,000					13:50 ノオペ
国債買現先									国債補完供給(10/23-10/24) ▲0.500% 全取 55億
国債売現先									12:50 ノオペ
共通担保(本店)									13:00 ノオペ
共通担保(全店)	▲2,000	+1,600							13:50 ノオペ
CP買現先									国債補完供給(10/23-10/24) ▲0.500% 全取 10億
CP等買入	▲100		▲200						
社債等買入	▲100					+1,000			
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+1,500	▲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	▲19,600		+10,800		+3,000		▲4,000		
当座預金残高	3,681,700		3,692,500		3,695,500		3,691,500		
準備預金残高	3,252,800		3,250,100		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) 3,320
積み終了先	3,250,100		ノオペ		ノオペ		ノオペ		国債買現先 0
超過準備	3,250,000		ノオペ		ノオペ		ノオペ		CP買現先 0
非準備先残高	428,900		ノオペ		ノオペ		ノオペ		成長基盤強化 92,686
準備預金進捗率	99.6%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		被災地金融機関支援 5,088
平均	25.8%		予想込増減	+10,800	予想込増減	+3,000	予想込増減	▲4,000	被災地金融機関支援 5,088
乖離率	73.8%		当預見込	3,692,500	当預見込	3,695,500	当預見込	3,691,500	ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,019,500
10/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 11,900
10/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.040	-	-0.100	-0.105
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

10/20 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,757,600**

(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%

10/20 のコール市場残高(前日比)

	合計	平均	対前日
有担	95,564	22,926	+2,349
無担	72,638		+1,571
			+778

*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	-0.075	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.042	-	-	-0.028	-0.040	-0.035	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.097	-0.096	-	-0.114	-0.114	-0.114	-0.116	-	-0.135	-0.137	-0.161

§ 10/24 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.075～+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。

10/24 の予定(国内)

9:00 日銀営業毎旬報告(10月20日現在)

10/24 の予定(海外)

米 10月の製造業PMI速報
10月のサービス業PMI速報

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
◎ ノオペ	+10,800	3,692,500	+3,692,500	-0.075	-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