

DAILY SIGNAL

平成29年10月30日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは326兆7,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は▲0.05～▲0.03%の水準で取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、後場に入って▲0.06%台で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	所要対比
8:00	-	-	3,267,000	3,267,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/30 のオペ結果
	10/30(月)		10/31(火)		11/1(水)		11/2(木)		
券	+0		▲700		+0		▲1,000		9:20 ノオベ
財政	▲12,500		+600		▲2,000		▲2,000		10:10 国債買入(11/1-)
過不足	▲12,500		▲100		▲2,000		▲3,000		(残存1年以下)
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	+0.001% 按分(58.2%)702億
国債買入				+7,500		+6,500			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+2,500					▲0.002% 按分(96.7%)2,804億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
国債売現先									+0.000% 按分(95.3%)3,001億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)	▲1,400	+1,300							国債補完供給(10/30-10/31)
CP買現先									▲0.500% 全取 166億
CP等買入	▲500		▲700	+3,000					12:50
社債等買入	▲100		▲100						ノオベ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									ノオベ
被災地金融機関支援									13:50
貸出									国債補完供給(10/30-10/31)
国債補完供給		▲200	+200						▲0.500% 全取 30億
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	▲13,400		+12,300		+4,500		▲3,000		
当座預金残高	3,694,100		3,706,400		3,710,900		3,707,900		
準備預金残高	3,267,900		3,267,600		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 3,281
積み終了先	3,267,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0
超過準備	3,267,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0
非準備先残高	426,200		ノオベ		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化 92,686
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		被災地金融機関支援 5,088
平均	48.4%		48.4%		48.4%		48.4%		ロンハート残高 0
乖離率	51.5%		51.5%		51.5%		51.5%		
予想込増減	+12,300		+12,300		+4,500		▲3,000		
当預見込	3,706,400		3,706,400		3,710,900		3,707,900		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,019,000
10/31 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,100
10/31 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.030	-0.100
レボ	-0.065	-0.105
ビッド	-0.065	0.000
出値	-	-

10/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,769,200

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	10/20
長期国債	282	361	409
CP等	2.2	2.3	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	16.1
J-REIT	0.27	0.36	0.44
貸出支援基金	31	41	48
国庫短期証券	43	50	29
その他とも資産計	383	476	515
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	370
その他とも負債・純資産計	383	476	515

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
10/26	717 (3M)	-0.1898%	-0.1961%
10/19	716 (3M)	-0.1861%	-0.1924%
10/18	715 (1Y)	-0.1618%	-0.1687%

10/27 のコール市場残高(前日比)

	合計	平均利回
有担	96,163	+800
無担	22,704	+369
	73,459	+431

*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	-	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.022	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.040	-	-	-0.035	-0.031	-	-	-	0.050	-	-
東京レボ・レート	-0.100	-0.152	-	-0.108	-0.110	-0.113	-0.116	-	-0.133	-0.137	-0.162

§ 10/31 オファ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。

10/31 の予定(国内)

未定 金融政策決定会合の結果
経済・物価情勢の展望(10月の基本的見解)
黒田日銀総裁、会見

10/31 の予定(海外)

米 FOMC(11月1日まで)
10月の消費者信頼感指数
7～9月のGDP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
◎ ノオベ	+12,300	3,706,400	+3,706,400	-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	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2017/10/30 ~ 2017/11/13	8,000	1,311	1,311	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
2017/10/23 ~ 2017/11/6	8,000	1,630	1,630	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
2017/10/18 ~ 2017/10/19	1,000	51	51	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
2017/10/16 ~ 2017/10/30	8,000	1,350	1,350	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
2017/10/10 ~ 2017/10/23	8,000	2,035	2,035	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2017/10/2 ~ 2017/10/16	8,000	2,250	2,250	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2017/9/25 ~ 2017/10/10	8,000	2,386	2,386	0.00%	固定金利	-	札割れ	10/26 ~ 11/2	担保範囲内	0	0	1.650%	固定金利	0.0%	応れなし
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

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