

DAILY SIGNAL

平成29年11月1日(水)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 11/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは326兆3,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.04%の合出から始まり、その後は▲0.055～▲0.035%の水準で取引された。調達一巡後は▲0.06%台で調整程度の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オフー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,263,000	3,263,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/1 のオペ結果
	11/1(水)		11/2(木)		11/6(月)		11/7(火)		
券	▲600		▲1,400		+2,000		+1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲9,000		▲12,100		▲24,000		+2,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲9,600		▲13,500		▲22,000		+3,000		11:50 国債補完供給(11/1-11/2) ▲0.500% 全取 7億
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	12:50 ノーオペ
国債買入	+6,600								13:00 共通担保(全店)<固定金利> (11/6-11/20) 0%全取 1,379億
国庫短期証券買入					▲1,900	+1,500			共通担保(全店)<固定金利> (11/6-2/13) 0%全取 170億
国債買現先									13:50 国債補完供給(11/1-11/2) ▲0.500% 全取 113億
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲100	▲100					
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+600	▲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	▲2,900		▲13,600		▲22,400		+3,000		
当座預金残高	3,701,200		3,687,600		3,665,200		3,668,200		
準備預金残高	3,264,100		3,263,900		共通担保オペ当社予想		ノーオペ		共通担保(全店) 3,281
積み終了先	3,263,900		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先 0
超過準備	3,263,800		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		CP買現先 0
非準備先残高	437,100		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		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	54.8%		54.8%		54.8%		54.8%		ロンハート残高 0
乖離率	45.1%		45.1%		45.1%		45.1%		
予想込増減	▲13,600		▲13,600		▲22,400		▲22,400		
当預見込	3,687,600		3,687,600		3,665,200		3,668,200		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,019,200
11/2 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,600
11/2 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
オフー	-0.030	-	-0.100	-0.185
ビッド	-0.065	-	0.000	-0.115
出来値	-	-	-	-

10/31 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,766,600

(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	回号	最高利回	平均利回
11/1	718 (3M)	-0.1842%	-0.1897%
10/26	717 (3M)	-0.1898%	-0.1961%
10/19	716 (3M)	-0.1861%	-0.1924%

10/31 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	87,678	-4,406	-1,234
	20,851	-	-3,172
	66,827	-	-

*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	-0.020	-	-0.040	-0.035	-	-0.035	-	-	-	-
最高	0.001	-0.005	-	-0.035	-0.030	-	0.010	-	-	-	-
加重平均	-0.044	-0.010	-	-0.037	-0.033	-	-0.022	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.108	-0.153	-	-0.122	-0.119	-0.119	-0.123	-	-0.134	-0.138	-0.162

§ 11/2 オフターのオペと市場動向予想

足許は▲0.065～+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。

11/2 の予定(国内)

8:50 前週の対外及び対内証券売買契約等の状況 (財務省)

11/2 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数 (FRB議長人事)

10:00 10月31日現在の営業毎旬報告(日銀)

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	当日増減	当日残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	▲13,600	3,687,600	+3,687,600	-0.065	-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	オフー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2017/11/6 ~ 2017/11/20	8,000	1,379	1,379	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/11/6 ~ 2018/2/13	5,000	170	170	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/10/30 ~ 2017/11/13	8,000	1,311	1,311	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/10/23 ~ 2017/11/6	8,000	1,630	1,630	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/10/18 ~ 2017/10/19	1,000	51	51	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

*当日物

期間	オフー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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	オフー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
11/2 ~ 11/9	担保範囲内	2	2	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
10/26 ~ 11/2	担保範囲内	0	0	1.650%	固定金利	0.0%	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