

DAILY SIGNAL

平成29年11月2日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは325兆円だった。
無担保コールON物は▲0.04%の割合から始まった。
その後は▲0.05～▲0.035%のレンジで出合が見られた。
後場では▲0.06%台で調整程度の出合が散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,250,000	3,250,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/2 のオペ結果
	11/2(木)		11/6(月)		11/7(火)		11/8(水)		
券	▲1,300		+1,200		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲2,600		▲24,100		+2,000		+0		ノオベ
過不足	▲3,900		▲22,900		+3,000		+1,000		10:10
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	国庫短期証券買入(11/7-)
国債買入									▲0.004% 全取1,000億
国庫短期証券買入									国債買入(11/7-)
国債買現先									(残存5年超10年以下)
国債売現先									▲0.002% 按分(75.8%) 4,105億
共通担保(本店)			▲1,900	+1,500					(残存10年超25年以下)
共通担保(全店)									+0.000% 按分(42.4%) 2,010億
CP買現先									(残存25年超)
CP等買入	▲100		▲200						▲0.004% 按分(3.5%) 1,008億
社債等買入	▲100								11:50
ETF買入									国債補完供給(11/2-11/6)
J-REIT買入									▲0.500% 全取 207億
被災地金融機関支援									12:50
貸出									ノオベ
国債補完供給	+100	▲400	+400						13:00
米ドル供給用担保国債供給									ノオベ
成長基盤強化支援									13:50
貸出増加支援									国債補完供給(11/2-11/6)
									▲0.500% 全取 190億
当座預金増減	▲4,400		▲23,100		+11,100		+1,000		
当座預金残高	3,696,800		3,673,700		3,684,800		3,685,800		
準備預金残高	3,253,700		3,253,500		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 3,281
積み終了先	ノオベ		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0
超過準備	3,253,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0
非準備先残高	443,100		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	67.7%		67.7%		67.7%		67.7%		ロンハート残高 0
乖離率	32.2%		32.2%		32.2%		32.2%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,019,200
11/6 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,500
11/6 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
ビッド	-0.050	0.000
出来値	-	-

11/1 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,764,400**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	10/31
長期国債	282	361	412
CP等	2.2	2.3	2.2
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	518
銀行券	98	102	102
当座預金	253	330	370
その他とも負債・純資産計	383	476	518

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%

11/1 のコール市場残高(前日比)

	合計	92,504	+4,826
有担	18,232	-2,619	
無担	74,272	+7,445	

*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	-	-	-0.035	-0.035	-	-0.040	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-0.015	-	0.005	-	-	-	-
加重平均	-0.044	-	-	-0.012	-0.029	-	-0.029	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.112	-0.108	-	-0.129	-0.126	-0.126	-0.128	-	-0.136	-0.142	-0.164

§ 11/6 オファ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。
共通担保オペはノオベを予想。

11/6 の予定(国内)

日米首脳会談
黒田日銀総裁が名古屋の各界代表者と懇談・会見
8:50 9月20～21日の金融政策決定会合議事要旨(日銀)

11/6 の予定(海外)

米 NY連銀総裁の講演
欧 ユーロ圏財務相会合(ブリュッセル)

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
◎ ノオベ	▲23,100	3,673,700	+3,673,700	-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)						*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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	
2017/11/6 ~ 2017/11/20	8,000	1,379	1,379	0.00%		-	札割れ	2017/5/24 ~ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	札割れ	2017/5/24 ~ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	札割れ	
2017/11/6 ~ 2018/2/13	5,000	170	170	0.00%		-	札割れ	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ	
2017/10/30 ~ 2017/11/13	8,000	1,311	1,311	0.00%		-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ	
2017/10/23 ~ 2017/11/6	8,000	1,630	1,630	0.00%		-	札割れ	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24	
2017/10/18 ~ 2017/10/19	1,000	51	51	0.00%		-	札割れ	米ドル資金供給オペ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	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
2017/10/16 ~ 2017/10/30	8,000	1,350	1,350	0.00%		-	札割れ	10/26 ~ 11/2	担保範囲内	0	0	1.650%	固定金利	0.0%	応札なし									
2017/10/10 ~ 2017/10/23	8,000	2,035	2,035	0.00%		-	札割れ																	
2017/10/2 ~ 2017/10/16	8,000	2,250	2,250	0.00%		-	札割れ																	

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