

DAILY SIGNAL

平成29年10月4日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/4 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは323兆2,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.04%の合出からスタート。
その後はビッドが厚くなり、▲0.03~▲0.04%のレンジで取引された。
後場では▲0.035~▲0.06%のレンジ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	-	-	3,232,000	3,232,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/4 のオペ結果
	10/4(水)		10/5(木)		10/6(金)		10/10(火)		
券	+200		▲1,000		▲1,000		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(10/6-) (残存1年超3年以下) ▲0.011% 按分(36.1%) 2,804億 (残存3年超5年以下) ▲0.018% 按分(31.9%) 3,004億 (残存5年超10年以下) ▲0.017% 按分(19.8%) 4,104億 11:50 国債補完供給(10/4-10/5) ▲0.500% 全取 68億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲34,000		▲18,500		+2,000		▲23,000		
過不足	▲33,800		▲19,500		+1,000		▲22,000		
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	
国債買入									
国庫短期証券買入									
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲2,400		
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲300						
社債等買入									
ETF買入				+100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+100	▲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	▲34,000		▲19,600		+1,000		▲24,400		
当座預金残高	3,654,100		3,634,500		3,635,500		3,611,100		
準備預金残高	3,224,600		3,224,100		3,224,100		3,224,100		
積み終了先	3,224,100		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
超過準備	3,224,100		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
非準備先残高	429,500		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	63.3%		63.3%		63.3%		63.3%		
乖離率	36.6%		36.6%		36.6%		36.6%		
予想込増減	▲19,600		▲19,600		+1,000		▲16,400		
当預見込	3,634,500		3,634,500		3,635,500		3,619,100		
共通担保(全店)							4,976		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							92,686		
被災地金融機関支援							5,235		
ロンハート残高							0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,913,100
10/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,000
10/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	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G.C	-	-0.155
ビッド	-0.050	0.000
レボG.C	-	-0.125
出値	-	-

10/3 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,742,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	9/20
長期国債	282	361	402
CP等	2.2	2.3	2.5
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	6.9	11.1	15.7
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	510
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	370
その他とも負債・純資産計	383	476	510

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
10/4	712 (6M)	-0.1603%	-0.1643%
9/28	711 (3M)	-0.1550%	-0.1652%
9/20	710 (3M)	-0.1002%	-0.1074%

10/3 のコール市場残高(前日比)

	合計	99,460	+3,608
有担	21,730	+179	
無担	77,730	+3,429	

*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	-	-	-0.025	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.230	-	-	0.005	-	-	-	-
加重平均	-0.035	-	-	-0.028	-0.008	-	-0.015	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.098	-0.105	-	-0.103	-0.104	-0.106	-0.110	-	-0.120	-0.131	-0.152

§ 10/5 オファ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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

10/5 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)

10/5 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
8月貿易収支
欧 9月のECB理事会の議事要旨

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	▲19,600	3,634,500	+3,634,500	-0.065	-0.050	-0.050	-0.050	-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	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2017/10/2 ~ 2017/10/16	8,000	2,250	2,250	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/25 ~ 2017/10/10	8,000	2,386	2,386	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/19 ~ 2017/10/2	8,000	4,300	4,300	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/19 ~ 2017/12/25	5,000	120	120	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/11 ~ 2017/9/25	8,000	1,985	1,985	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/4 ~ 2017/9/19	8,000	1,360	1,360	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/28 ~ 2017/9/11	8,000	1,932	1,932	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/21 ~ 2017/9/4	8,000	1,451	1,451	0.00%	固定金利	-	札割れ

共通担保資金供給(本店)

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
2017/5/24 ~ 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	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
10/5 ~ 10/13	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
9/28 ~ 10/5	担保範囲内	400	400	1.630%	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