

DAILY SIGNAL

平成29年9月28日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは327兆3,000億円だった。無担保コールON物は▲0.04%の割合から始まった。その後は▲0.04~▲0.07%のレンジで取引された。調達一巡後は▲0.07%台で調整程度の割合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,273,000	3,273,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/28 のオペ結果
	9/28(木)		9/29(金)		10/2(月)		10/3(火)		
券		▲1,200		▲500		+1,000		+0	9:20 ノーオペ
財政		▲8,900		▲15,200		▲6,000		▲15,000	10:10 ノーオペ
過不足		▲10,100		▲15,700		▲5,000		▲15,000	11:50 ノーオペ
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 ノーオペ
国債買入				+9,100					13:00 ノーオペ
国庫短期証券買入									共通担保(全店)〈固定金利〉 (10/2-10/16) 0%全取 2,250億
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)					▲4,300	+2,300			
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲4,900	+2,500					
社債等買入			▲100						
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給									
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		▲10,500		▲9,100		▲7,000		▲15,000	
当座預金残高		3,704,400		3,695,300		3,688,300		3,673,300	
準備預金残高		3,284,900							
積み終了先		3,283,400							
超過準備		3,283,300							
非準備先残高		419,500							
準備預金進捗率		99.6%							
平均		43.3%	予想込増減	▲9,100	予想込増減	▲7,000	予想込増減	▲15,000	
乖離率		56.3%	当預見込	3,695,300	当預見込	3,688,300	当預見込	3,673,300	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,911,600
9/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 10,400
9/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	T/N	ユーロ円	T+2
無担	-	-	-
CP現先	-0.100	-	-0.095
レボG.C	-	-	-
オファー	-0.035	-	-0.100
ビッド	-0.060	-	0.000
出来値	-	-	-

9/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,768,600**

(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
9/28	711 (3M)	-0.1550%	-0.1652%
9/20	710 (3M)	-0.1002%	-0.1074%
9/15	709 (1Y)	-0.1278%	-0.1308%

9/27 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	94,807	21,276	73,531
	-781	-28	-753

*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	-0.073	-0.050	-	-0.045	-0.045	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.010	-	-0.030	-0.010	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	-0.041	-	-0.041	-0.038	-	0.001	-	0.050	-	-
東京レボ・レート	-0.072	-0.112	-	-0.094	-0.094	-0.097	-0.105	-	-0.119	-0.131	-0.152

9/29 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.086~+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。

9/29 の予定(国内)

8:30 CPI(8月全国、9月都区部)(総務省)
8:50 9月の金融政策決定会合における主な意見(日銀)

9/29 の予定(海外)

米 8月の個人消費支出
9月のシカゴ大消費者信頼感確報

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
◎ ノーオペ	▲9,100	3,695,300	+3,695,300	-0.086	-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	按分レート	平均レート	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	按分レート	平均レート	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率
9/28 ~ 10/5	担保範囲内	400	400	1.630%	固定金利	0.0%	1.00
9/21 ~ 9/28	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