

DAILY SIGNAL

平成28年10月4日(火)
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231兆円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%の合出から始まった。その後は▲0.06%～▲0.03%のレンジで取引され、一部▲0.025%まで取り上がる動きが見られた。後場に入っても地合に変化は見られず、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,310,000	+2,310,000

(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(火)		10/5(水)		10/6(木)		10/7(金)		
券	+800		▲100		+0		▲1,000		9:20
財政	▲35,000		+400		▲24,000		▲1,000		ノーオペ
過不足	▲34,200		+300		▲24,000		▲2,000		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	ノーオペ
国債買入		+7,900		+9,100					10:40
国庫短期証券買入		+17,500							米ドル資金供給(10/6-10/14)
国債買現先									貸付利率0.900% 420百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)							▲100		国債補完供給(10/4-10/5)
CP買現先			▲300						▲0.500% 全取 103億
CP等買入									12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+100	▲100	+100						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲8,800		+9,200		▲24,000		▲2,100		
当座預金残高	3,088,300		3,097,500		3,073,500		3,071,400		
準備預金残高	2,773,700								
積み終了先	2,304,600								共通担保(本店) 0
超過準備	2,304,600								共通担保(全店) 4,690
非準備預金残高	314,600								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.8%								CP買現先 0
平均	64.5%		予想込増減 +9,200		予想込増減 ▲24,000		予想込増減 +2,900		成長基盤強化 71,647
乖離率	35.3%		当預見込 3,097,500		当預見込 3,073,500		当預見込 3,076,400		被災地金融機関支援 4,880
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,075,500
10/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,900
10/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.300	-
ビット	-	-
出来値	-	-

10/3 時点のマナターベース(単位:億円) 4,106,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	9/20
長期国債	202	282	337
CP等	2.2	2.2	2.7
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	3.8	6.9	9.3
J-REIT	0.18	0.27	0.33
貸出支援基金	25	31	35
国庫短期証券	49	43	55
その他とも資産計	300	383	452
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	310
その他とも負債・純資産計	300	383	452

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
9/29	636(3M)	-0.3407%	-0.3547%
9/20	635(3M)	-0.3066%	-0.3286%
9/15	634(3M)	-0.3363%	-0.3549%

10/3 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	74,048	+13,837	+11,322
	21,095	+11,322	
	52,953	+2,515	

*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	-0.080	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.036	-	-	-0.023	-	0.020	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.085	-0.087	-	-0.090	-0.095	-0.098	-0.112	-	-0.161	-0.229	-0.233

§ 10/5 オフアのオペと市場動向予想

足許は▲0.07～▲0.02%のレンジで取引されよう。
共通担保オペは低調な応札が続いていたことから減額
オフアされると予想。

10/5 の予定(国内)

13:00 10月の日銀当座預金増減要因見込み(日銀)
14:00 8月の基礎的なインフレ率を補足するための指標(日銀)
需給ギャップと潜在成長率(日銀)

10/5 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
9月のADP雇用統計

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	+9,200	3,097,500	+3,097,500	-0.080	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.070	-0.070
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

共通担保資金供給(全店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/10/3 ~ 2016/10/17	8,000	1,910	1,910	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/9/26 ~ 2016/10/11	8,000	2,400	2,400	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/9/20 ~ 2016/10/3	8,000	4,540	4,540	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/9/12 ~ 2016/9/26	8,000	1,970	1,970	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/9/5 ~ 2016/9/20	8,000	1,660	1,660	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/29 ~ 2016/9/12	8,000	1,891	1,891	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/22 ~ 2016/9/5	8,000	1,891	1,891	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/15 ~ 2016/8/29	8,000	1,941	1,941	0.00%	固定金利	- 札割れ

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
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%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

米ドル資金供給オペ

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
10/6 ~ 10/14	担保範囲内	420	420	0.900%	固定金利	- 1.00
9/29 ~ 10/6	担保範囲内	655	655	0.850%	固定金利	- 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ありません。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