

DAILY SIGNAL

平成28年10月5日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/5 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは232兆5,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.02%の出合から始まり、その後は▲0.035%～▲0.02%のレンジで取引される堅調な地となった。昨日に引き続き調達意欲が高く、一部▲0.015%まで取り上げる動きも見られた。調達一巡後もビッド水準は変わらず、調整程度の出合が散見されて引けた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,325,000	+2,325,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/5 のオペ結果
	10/5(水)		10/6(木)		10/7(金)		10/11(火)		
券	+0		▲900		▲1,000		+1,000		9:20
財政	+1,100		▲25,200		+2,000		▲40,000		ノーオペ
過不足	+1,100		▲26,100		+1,000		▲39,000		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	国債買入(10/7-)
国債買入		+9,100				+12,600			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									▲0.007%按分(92.0%) 4,001億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)					▲100	+200	▲2,500		▲0.005%按分(24.1%) 4,207億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									+0.005%按分(64.0%) 4,107億
CP等買入	▲300		▲200						(物価連動債)
社債等買入									▲0.400円按分(75.5%) 253億
ETF買入									10:40
J-REIT買入									CP等買入(10/11-)
被災地金融機関支援									▲0.001%按分(75.2%) 3,489億
貸出									11:50
国債補完供給	+100	▲100	+100						国債補完供給(10/5-10/6)
成長基盤強化支援									▲0.500% 全取 131億
貸出増加支援									12:50
当座預金増減	+9,900		▲26,200		+13,700		▲38,000		ノーオペ
当座預金残高	3,098,200		3,072,000		3,085,700		3,047,700		13:00
準備預金残高	2,779,200		2,308,800		2,308,800		2,308,800		共通担保(全店) 固定金利
積み終了先	2,308,800		2,308,800		2,308,800		2,308,800		(10/7-1/16)
超過準備	2,308,800		2,308,800		2,308,800		2,308,800		0% 全取 210億
非準備先残高	319,000		319,000		319,000		319,000		共通担保(本店)
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		共通担保(全店)
平均	67.7%		67.7%		67.7%		67.7%		国債買現先
乖離率	32.1%		32.1%		32.1%		32.1%		CP買現先
									成長基盤強化
									被災地金融機関支援
									ローンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,075.500
10/6 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 3,100
10/6 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	-0.300	-
レボ	-	-0.100
ビッド	-	-0.090
出来値	-	0.000
	-	-0.080

10/4 時点のマナターベース(単位:億円) 4,096,500

(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
10/5	637(6M)	-0.3643%	-0.3743%
9/29	636(3M)	-0.3407%	-0.3547%
9/20	635(3M)	-0.3066%	-0.3286%

10/4 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	85,836	+11,788	-501
	20,594	-	-
	65,242	+12,289	-

*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	-0.070	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.030	-	-	-0.024	-	-	-0.001	-	-	-	-
東京レボレート	-0.085	-0.085	-	-0.090	-0.095	-0.097	-0.109	-	-0.163	-0.229	-0.233

§ 10/6 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.06～▲0.015%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。

10/6 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)

10/6 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
欧 9月のECB理事会議事要旨

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	
◎	ノーオペ	▲26,200	3,072,000	+3,072,000	-0.060	-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)					*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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/10/7 ~ 2017/1/16	5,000	210	210	0.00%	固定金利	-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ				
2016/10/3 ~ 2016/10/17	8,000	1,910	1,910	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24				
2016/9/26 ~ 2016/10/11	8,000	2,400	2,400	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70				
2016/9/20 ~ 2016/10/3	8,000	4,540	4,540	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46				
2016/9/12 ~ 2016/9/26	8,000	1,970	1,970	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/9/5 ~ 2016/9/20	8,000	1,660	1,660	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/8/29 ~ 2016/9/12	8,000	1,891	1,891	0.00%	固定金利	-	札割れ	10/6 ~ 10/14	担保範囲内	420	420	0.900%	固定金利	-	1.00				
2016/8/22 ~ 2016/9/5	8,000	1,891	1,891	0.00%	固定金利	-	札割れ	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