

DAILY SIGNAL

平成28年10月6日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは229兆1,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.015%の合出から始まった。その後は▲0.03%～▲0.01%のレンジで取引される堅調な合出であった。旺盛な調達意欲から、一部▲0.005%まで取り上げる動きも見られた。調達一巡後もビット水準は変わらず、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	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,291,000	+2,291,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/6 のオペ結果
	10/6(木)		10/7(金)		10/11(火)		10/12(水)		
券	▲700		▲900		+1,000		+0		9:20
財政	▲24,700		+2,000		▲40,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲25,400		+1,100		▲39,000		+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				+12,800					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(10/6-10/7)
国債買現先									▲0.500% 全取 98億
共通担保(本店)			▲100	+200	▲2,500	+2,000			12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲500			+3,500			共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入									(10/11-10/24)
ETF買入				+1,900					0% 全取 2,010億
J-REIT買入									
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	▲25,600		+15,500		▲36,000		+2,000		
当座預金残高	3,072,600		3,088,100		3,052,100		3,054,100		
準備預金残高	2,769,000								共通担保(本店)
積み終了先	2,295,200								共通担保(全店)
超過準備	2,295,200								国債買現先
非準備先残高	303,600								CP買現先
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化
平均	71.0%		予想込増減 +15,500		予想込増減 ▲36,000		予想込増減 +2,000		被災地金融機関支援
乖離率	28.9%		当預見込 3,088,100		当預見込 3,052,100		当預見込 3,054,100		ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,075,500
10/7 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 2,600
10/7 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	-0.010	-0.080
ビット	-0.030	-0.075
出来値	-	-

10/5 時点のマナターベース(単位:億円) 4,106,400

(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
10/6	638(3M)	-0.3120%	-0.3274%
10/5	637(6M)	-0.3643%	-0.3743%
9/29	636(3M)	-0.3407%	-0.3547%

10/5 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	89,903	20,584	69,319
	+4,067	-10	+4,077

*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	-0.060	-0.042	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.005	-	0.002	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.020	-0.012	-	-0.007	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.083	-	-0.092	-0.095	-0.100	-0.108	-	-0.163	-0.229	-0.233

§ 10/7 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.06～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペは期落ちなくノーオペを予想。

10/7 の予定(国内)

10:00 9月30日現在の営業毎旬報告(日銀)
14:00 8月の景気動向指数速報(内閣府)

10/7 の予定(海外)

米 9月の雇用統計
FRB副議長の講演
ブレイナードFRB理事の講演

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	+15,500	3,088,100	+3,088,100	-0.060	-0.025	-0.025	-0.025	-0.025	-0.025	-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	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/10/11 ~ 2016/10/24	8,000	2,010	2,010	0.00%	固定金利	札割れ
2016/10/7 ~ 2017/1/16	5,000	210	210	0.00%	固定金利	札割れ
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

*当日物

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	オファー額	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	-
9/29 ~ 10/6	担保範囲内	655	655	0.850%	固定金利	-

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