

DAILY SIGNAL

平成28年10月7日(金)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 10/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは230兆2,000億円だった。
週末となる本日の無担保コールON物は、朝方▲0.01%の出合から始まり、その後も▲0.03～▲0.01%のレンジで取引された。昨日に引き続き旺盛な調達意欲から、一部▲0.005%まで取り上がる地合となった。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	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,302,000	+2,302,000

	日銀速報 10/7(金)		日銀予想 10/11(火)		当社需給予想				10/7 のオペ結果
	▲800		+700		10/12(水)		10/13(木)		9:20
券	+3,900		▲40,300		+2,000		+2,000		ノーオペ
財政	+3,100		▲39,600		+2,000		+2,000		10:10
過不足	+12,800		+200		+7,100		+30,000		国庫短期証券買入(10/12-)
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	+0.013%按分(37.6%) 30,004億
国債買入									国債買入(10/12-)
国庫短期証券買入									(残存5年超10年以下)
国債買現先									▲0.004%按分(52.5%) 4,108億
共通担保(本店)	▲100	+200	▲2,500	+2,000					(残存10年超25年以下)
共通担保(全店)									+0.006%按分(96.6%) 1,906億
CP買現先									(残存25年超)
CP等買入	▲500		▲300	+3,500					+0.008%按分(88.8%) 1,110億
社債等買入		+1,900		+200					11:50
ETF買入									国債補完供給(10/7-10/11)
J-REIT買入									▲0.500% 全取 340億
被災地金融機関支援貸出									12:50
国債補完供給	+100	▲400	+400						ノーオペ
成長基盤強化支援貸出増加支援									13:00
									ノーオペ
									13:50
									国債補完供給(10/7-10/11)
									応礼0億
当座預金増減	+17,100		▲36,300		+39,100		+0		共通担保(本店)
当座預金残高	3,089,700		3,053,400		3,092,500		3,092,500		共通担保(全店)
準備預金残高	2,776,700		2,776,700		2,776,700		2,776,700		0
積み終了先	2,304,900		2,304,900		2,304,900		2,304,900		国債買現先
超過準備	2,304,500		2,304,500		2,304,500		2,304,500		0
非準備先残高	313,000		313,000		313,000		313,000		CP買現先
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		0
平均	83.9%		83.9%		83.9%		83.9%		成長基盤強化
乖離率	16.0%		16.0%		16.0%		16.0%		71,647
									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) 2,088,800
10/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 400
10/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.020	-	-0.100	-0.085
ビッド	-	-	0.000	-0.070
出来値	-	-	-	-

10/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,081,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	9/30
長期国債	202	282	341
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	9.8
J-REIT	0.18	0.27	0.34
貸出支援基金	25	31	35
国庫短期証券	49	43	57
その他とも資産計	300	383	457
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	312
その他とも負債・純資産計	300	383	457

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%

10/6 のコール市場残高(前日比)

合計	89,228	-675
有担	20,223	-361
無担	69,005	-314

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.018	-	-	-0.020	-	0.020	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.083	-0.076	-	-0.092	-0.095	-0.100	-0.110	-	-0.163	-0.229	-0.233

§ 10/11 オファ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。

10/11 の予定(国内)

8:50 8月の国際収支(財務省)
9月の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

10/11 の予定(海外)

米 FRBの9月の労働市場情勢指数

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
◎	ノーオペ	▲36,300	3,053,400	+3,053,400	-0.060	-0.025	-0.025	-0.025	-0.025	-0.025
					～	～	～	～	～	～
					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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	
2016/10/11 ~ 2016/10/24	8,000	2,010	2,010	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	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2016/10/7 ~ 2017/1/16	5,000	210	210	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	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
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																	
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	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									
10/6 ~ 10/14	担保範囲内	420	420	0.900%	固定金利	—	1.00	10/6 ~ 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