

DAILY SIGNAL

平成28年10月11日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/11 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは228兆6,000億円だった。
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▲0.05～▲0.01%のレンジで取引された。
後場に入っても地合いは変わらず、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,286,000	+2,286,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/11 のオペ結果
	10/11(火)		10/12(水)		10/13(木)		10/14(金)		
券	+900		+1,100		+0		▲1,000		9:20
財政	▲38,900		▲2,500		+0		+63,000		ノーオペ
過不足	▲38,000		▲1,400		+0		+62,000		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				+7,400					11:50
国庫短期証券買入				+30,100					国債補完供給(10/11-10/12)
国債買現先									▲0.500% 全取 192億
共通担保(本店)	▲2,500	+2,000					▲100		12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先			▲500						13:00
CP等買入	▲300	+3,500							ノーオペ
社債等買入									13:50
ETF買入		+200							ノーオペ
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+400	▲200	+200						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲34,900		+35,800		+0		+61,900		
当座預金残高	3,054,800		3,090,600		3,090,600		3,152,500		
準備預金残高	2,760,400		2,290,600		2,290,600		2,290,600		共通担保(本店)
積み終了先	2,290,600		2,290,600		2,290,600		2,290,600		共通担保(全店)
超過準備	2,290,600		2,290,600		2,290,600		2,290,600		国債買現先
非準備先残高	294,400		294,400		294,400		294,400		CP買現先
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化
平均	87.1%		87.1%		87.1%		87.1%		被災地金融機関支援
乖離率	12.8%		12.8%		12.8%		12.8%		ロンバート残高
予想込増減	+35,800		+35,800		+0		+61,900		
当預見込	3,090,600		3,090,600		3,090,600		3,152,500		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,088,800
10/12 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 300
10/12 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
レボ	-	-0.080
ビッド	-	0.000
出来値	-	-0.070

10/7 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,099,500

(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%

10/7 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	88,463	19,753	68,710
	-765	-470	-295

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.028	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.081	-0.075	-	-0.087	-0.093	-0.098	-0.105	-	-0.163	-0.229	-0.233

§ 10/12 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があるが、低調な応札が続いて
いることからロールオファーは見送られると予想。

10/12 の予定(国内)

8:50 8月の機械受注(内閣府)
10:00 10月10日現在の営業毎旬報告(日銀)
原田日銀審議委員が金融経済懇親会に出席・会見

10/12 の予定(海外)

米 週間MBA住宅ローン申請指数
9月20～21日のFOMC議事録
カンザスシティ連銀総裁の講演

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	+35,800	3,090,600	+3,090,600	-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

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	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