

DAILY SIGNAL

平成28年10月12日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは230兆7,000億円だった。
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▲0.04~▲0.02%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.055%近辺での出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,307,000	+2,307,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/12 のオペ結果
	10/12(水)		10/13(木)		10/14(金)		10/17(月)		
券	+1,100		▲600		▲1,000		+0		9:20
財政	▲2,500		+3,300		+63,000		▲8,000		ノーオペ
過不足	▲1,400		+2,700		+62,000		▲8,000		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							10:40
国庫短期証券買入		+30,100							米ドル資金供給(10/14-10/20)
国債買現先									貸付利率0.900% 応札0百万米ドル
共通担保(本店)						▲100			11:50
共通担保(全店)							▲1,900		国債補完供給(10/12-10/13)
CP買現先									▲0.500% 全取 824億
CP等買入	▲500		▲300						12:50
社債等買入				+500					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	+200	▲900	+900						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+34,900		+3,800		+61,900		▲9,900		
当座預金残高	3,089,700		3,093,500		3,155,400		3,145,500		
準備預金残高	2,777,600								共通担保(本店)
積み終了先	2,305,600								共通担保(全店)
超過準備	2,305,600								国債買現先
非準備先残高	312,100								CP買現先
準備預金進捗率	99.3%								成長基盤強化
平均	90.3%		予想込増減 +3,800		予想込増減 +61,900		予想込増減 ▲1,900		被災地金融機関支援
乖離率	9.6%		当預見込 3,093,500		当預見込 3,155,400		当預見込 3,153,500		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,088,800
10/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
10/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	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G.C	-	-0.100
ビッド	-	0.000
レボG.C	-	-0.080
出来値	-	-

10/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,063,700

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	10/10
長期国債	202	282	344
CP等	2.2	2.2	1.9
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	10.0
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	56
その他とも資産計	300	383	460
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	309
その他とも負債・純資産計	300	383	460

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%

10/11 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
最高利回	81.938	-6.525	
平均利回	19.834	+81	
最低利回	62.104	-6.606	

*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	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.032	-	-0.023	-0.010	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.080	-0.075	-	-0.088	-0.093	-0.098	-0.102	-	-0.163	-0.225	-0.233

§ 10/13 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分がロールオファーされると予想。

10/13 の予定(国内)

8:50 9月の貸出・預金動向(日銀)
13:30 8月の第3次産業活動(経産省)
未定 原田審議委員記者会見の要旨(日銀)

10/13 の予定(海外)

米 9月の輸入物価指数
週間新規失業保険申請件数

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	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	+3,800	3,093,500	+3,093,500	-0.060	-0.035	-0.035	-0.035	-0.035	-0.035	-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%

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