DAILY SIGNAL

平成28年10月13日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/13 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▲0.04%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。一部で試し取りと思われる動きが見られたが、
地合いに大きな変化はなく、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				10/13 のオペ結果
	10/13(木)		10/14(金)		10/17(月)		10/18(火)		
券	▲400		▲700		+0		+0		9:20
財政	+1,900		+62,900		▲8,000		▲26,000		ノーオペ
過不足	+1,500		+62,200		▲8,000		▲26,000		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(10/17-)
国債買入									(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入						+7,100			+0.000%按分(16.3%) 4,106億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)			▲100		▲1,900	+1,900	▲100		▲0.002%按分(14.3%) 1,906億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先			▲900						▲0.009%按分(50.4%) 1,103億
CP等買入	▲300		▲200						11:50
社債等買入				+400					国債補完供給(10/13-10/14)
ETF買入		+500							▲0.500% 全取 967億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+900	▲1,000	+1,000						共通担保(全店)(固定金利)
成長基盤強化支援									(10/17-10/31)
貸出増加支援									0% 全取 1,861億
当座預金増減	+1,600		+62,400		▲900		▲26,100		
当座預金残高	3,091,300		3,153,700		3,152,800		3,126,700		
準備預金残高	2,777,200		2,805,500		2,805,500		2,805,500		共通担保(本店)
積み終了先	2,305,500		2,305,500		2,305,500		2,305,500		共通担保(全店)
超過準備	2,305,500		2,305,500		2,305,500		2,305,500		国債買現先
非準備先残高	314,100		314,100		314,100		314,100		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	93.5%		93.5%		93.5%		93.5%		被災地金融機関支援
乖離率	6.4%		6.4%		6.4%		6.4%		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,088,800
10/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
10/14 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	0.000	-0.080
ビッド	-0.030	-0.070
出来値	-	-

10/12 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,097,500**

(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
10/13	639(3M)	-0.2735%	-0.2925%
10/6	638(3M)	-0.3120%	-0.3274%
10/5	637(6M)	-0.3643%	-0.3743%

10/12 のコール市場残高(前日比)		
合計	79,499	-2,439
有担	19,191	-643
無担	60,308	-1,796

*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	-0.030	-	-0.030	-	-	-	-
最高	0.050	-	-	0.000	-0.020	-	0.003	-	-	-	-
加重平均	-0.032	-0.005	-	-0.016	-0.027	-	-0.021	-	-	-	-
東京レボレート	-0.080	-0.107	-	-0.090	-0.093	-0.098	-0.102	-	-0.162	-0.225	-0.233

§ 10/14 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。
共通担保オペは低調な応札が続いていたことから、
ノーオペを予想する。

10/14 の予定(国内)

8:50 前週の対外対内証券売買契約等の状況(財務省)
9月のマネーストック(日銀)

10/14 の予定(海外)

10月のミシガン消費者信頼感速報
FRB議長の講演
ホストン連銀総裁の講演

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	当増減	当預残高	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y								
◎	ノーオペ	+62,400	3,153,700	+3,153,600	-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								

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
2016/10/17 ~ 2016/10/31	8,000	1,861	1,861	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

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