

DAILY SIGNAL

平成28年10月14日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは235兆5,000億円だった。
積最終日である本日の無担保コールON物は、朝方▲0.03%の出合から始まり、
その後は▲0.05～▲0.02%のレンジで取引された。
調達一巡後も出合の水準は変わらず、後場にかけて調整程度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	着地残対比
8:00	-	-	2,355,000	+2,355,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/14 のオペ結果
	10/14(金)		10/17(月)		10/18(火)		10/19(水)		
券	▲600		+900		+0		+0		9:20
財政	+62,600		▲15,400		▲26,000		+1,000		ノーオペ
過不足	+62,000		▲14,500		▲26,000		+1,000		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	国庫短期証券買入(10/18-)
国債買入				+7,400					+0.016%按分(92.4%) 17,501億
国庫短期証券買入						+17,500			10:40
国債買現先									社債等買入(10/20-)
共通担保(本店)									▲0.214%按分(58.3%) 1,000億
共通担保(全店)	▲100		▲1,900	+1,900	▲100				11:50
CP買現先									国債補完供給(10/14-10/17)
CP等買入	▲900		▲900						▲0.500% 全取 43億
社債等買入	▲200								12:50
ETF買入		+400							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	+1,000								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+62,200		▲8,000		▲8,600		+1,000		
当座預金残高	3,153,500		3,145,500		3,136,900		3,137,900		
準備預金残高	2,828,900		2,347,600		2,347,600		2,347,600		共通担保(本店)
積み終了先	2,347,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
超過準備	2,347,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先
非準備預金残高	324,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		CP買現先
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		成長基盤強化
平均	100.0%		予想込増減 ▲8,000		予想込増減 ▲8,600		予想込増減 +1,000		被災地金融機関支援
乖離率	0.0%		当預見込 3,145,500		当預見込 3,136,900		当預見込 3,137,900		ロンバート残高

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,153,500
10/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 494,400
10/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 16,500

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-	-0.100
レボ	-0.030	-0.080
ビッド	-	-
出来値	-	-

10/13 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,099,600**

(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%

10/13 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	80,543	+1,044	-
有担	18,929	-262	-
無担	61,614	+1,306	-

*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	-0.075	-	-	-0.030	-	-	-0.035	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.010	-	-	0.005	-	-	-	-
加重平均	-0.035	-	-	-0.013	-	-	-0.026	-	-	-	-
東京レボレート	-0.094	-0.078	-	-0.091	-0.095	-0.099	-0.101	-	-1.160	-0.225	-0.233

§ 10/17 オペ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。
共通担保オペはノーオペを予想する。

10/17 の予定(国内)

8:50 8月のマネタリーサーベイ(日銀)
14:00 地域経済報告[さくらレポート](日銀)
日銀支店長会議(黒田総裁あいさつ)

10/17 の予定(海外)

米 10月のNY連銀製造業景況感指数
9月の鉱工業生産
ユーロ圏 9月の消費者物価確報

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	▲8,000	3,145,500	+3,145,500	-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
2016/10/17 ~ 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