

# DAILY SIGNAL

平成28年10月17日(月)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 10/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは236兆1,000億円だった。  
新積み期となる本日の無担保コールON物は、朝方▲0.025%の合出から始まり、  
その後は▲0.07～▲0.025%のレンジで取引された。  
調達一巡後はビッドが薄くなり、後場にかけて▲0.07～▲0.065%のレンジで  
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	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,361,000	+2,361,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/17 のオペ結果
	10/17(月)		10/18(火)		10/19(水)		10/20(木)		
券	+900		+0		+0		▲1,000		9:20
財政	▲13,400		▲24,000		+1,000		▲22,000		ノーオペ
過不足	▲12,500		▲24,000		+1,000		▲23,000		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(10/19-)
国債買入		+7,400				+12,300			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+17,500					+0.004%按分(8.2%) 4,004億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									+0.003%按分(9.5%) 4,204億
共通担保(全店)	▲1,900	+1,900	▲100						(残存5年超10年以下)
CP買現先									+0.002%按分(96.8%) 4,108億
CP等買入	▲900		▲300						11:50
社債等買入			▲100						国債補完供給(10/17-10/18)
ETF買入								+1,000	▲0.500% 全取 38億
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									ノーオペ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲6,000		▲7,000		+13,300		▲22,000		
当座預金残高	3,147,500		3,140,500		3,153,800		3,131,800		
準備預金残高	2,833,800		2,228,500		共通担保オペ当社予想		共通担保(本店)		0
積み終了先	ノーマル		ノーマル		ノーマル		共通担保(全店)		4,281
超過準備	2,030,500		ノーマル		ノーマル		国債買現先		0
非準備先残高	313,700		ノーマル		ノーマル		CP買現先		0
準備預金進捗率	92.0%		ノーマル		ノーマル		成長基盤強化		71,647
平均	6.5%		予想込増減 ▲7,000		予想込増減 +13,300		予想込増減 ▲22,000		被災地金融機関支援
乖離率	85.5%		当預見込 3,140,500		当預見込 3,153,800		当預見込 3,131,800		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,153,500  
10/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 173,300  
10/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 6,000

	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G.C	-0.100	-0.100
ビッド	-0.040	0.000
レボG.C	-0.090	-0.090
出来値	-	-

10/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,162,400

(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%

10/14 のコール市場残高(前日比)			
合計	81,034	+491	
有担	19,021	+92	
無担	62,013	+399	

\*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	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.015	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	-0.010	-	-0.027	-0.030	-	-0.030	-	-	-	-
東京レボレート	-0.086	-0.085	-	-0.092	-0.095	-0.099	-0.101	-	-0.159	-0.225	-0.233

## § 10/18 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.07～+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。

## 10/18 の予定(国内)

なし

## 10/18 の予定(海外)

米 消費者物価指数(9月)  
NAHB住宅市場指数(10月)

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	▲7,000	3,140,500	+3,140,500	-0.070	-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

## \*当日物

## 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
10/14 ~ 10/20	担保範囲内	0	0	0.900%	固定金利	- 札割れなし
10/6 ~ 10/14	担保範囲内	420	420	0.900%	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