

DAILY SIGNAL

平成28年10月19日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/19 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは236兆3,000億円だった。
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▲0.06～▲0.03%のレンジで取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.07%の出合も見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,363,000	+2,363,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/19 のオペ結果
	10/19(水)		10/20(木)		10/21(金)		10/24(月)		
券	▲900		▲1,300		▲2,000		+0		9:20
財政	+2,500		▲24,500		+2,000		▲8,000		ノーオペ
過不足	+1,600		▲25,800		+0		▲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	国債買入(10/21-)
国債買入		+12,500				+11,200			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.005%按分(85.0%) 4,004億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									0.000%按分(84.2%) 4,206億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先									▲0.001%按分(47.9%) 1,906億
CP等買入	▲400		▲300	+1,000					(残存25年超)
社債等買入			▲200						0.000%按分(89.7%) 1,105億
ETF買入									10:40
J-REIT買入									CP等買入(10/24-)
被災地金融機関支援									▲0.001%按分(44.9%) 3,496億
貸出									11:50
国債補完供給									国債補完供給(10/19-10/20)
米ドル供給用担保国債供給									▲0.500% 全取 42億
成長基盤強化支援									12:50
貸出増加支援									ノーオペ
									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	+13,700		▲25,300		+11,300		▲6,500		
当座預金残高	3,154,800		3,129,500		3,140,800		3,134,300		
準備預金残高	2,845,000								共通担保(本店)
積み終了先	2,344,500								共通担保(全店)
超過準備	2,324,800								国債買現先
非準備先残高	309,800								CP買現先
準備預金進捗率	98.0%								成長基盤強化
平均	12.9%		予想込増減 ▲25,300		予想込増減 +11,300		予想込増減 +1,500		被災地金融機関支援
乖離率	85.1%		当預見込 3,129,500		当預見込 3,140,800		当預見込 3,142,300		ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,153,500
10/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 43,000
10/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,600

	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	-	-0.095
ビッド	-0.040	-
レボG.C	-	-0.085
出来値	-	-

10/18 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,149,100

(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
10/18	640(1Y)	-0.3080%	-0.3219%
10/13	639(3M)	-0.2735%	-0.2925%
10/6	638(3M)	-0.3120%	-0.3274%

10/18 のコール市場残高(前日比)		
合計	79,466	-1,265
有担	19,199	-72
無担	60,267	-1,193

*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	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.015	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.041	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.085	-0.088	-	-0.091	-0.095	-0.099	-0.100	-	-0.158	-0.225	-0.232

§ 10/20 オファ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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

10/20 の予定(国内)

14:30 百貨店売上高(9月)
16:00 コンビニエンスストア売上高(9月)

10/20 の予定(海外)

欧 ECB理事会、ECB総裁会見
米 週間新規失業保険申請件数
中古住宅販売件数(9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	▲25,300	3,129,500	+3,129,500	-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

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
10/20 ~ 10/27	担保範囲内	1	1	0.910%	固定金利	-
10/14 ~ 10/20	担保範囲内	0	0	0.900%	固定金利	-

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