

DAILY SIGNAL

平成28年10月20日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは233兆4,000億円。無担ON物は▲0.055～▲0.03%のレンジで取引された。本日は市場レベルBCP・3市場(短期金融市場、証券市場、外国為替市場)合同訓練実施日であった。14時30分、日銀は同訓練の一環として即日スタートの共通担保オペ(本店)固定金利方式をオファー。応札・落札金額は22億円であった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,334,000	+2,334,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/20 のオペ結果
	10/20(木)		10/21(金)		10/24(月)		10/25(火)		
券	▲1,400		▲1,800		+0		+0		9:20
財政	▲24,500		+1,400		▲8,000		+3,000		ノーオペ
過不足	▲25,900		▲400		▲8,000		+3,000		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				+11,500					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(10/20-10/21)
国債買現先									▲0.500% 全取 45億
共通担保(本店)					▲2,000	+1,800			12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲300		▲500			+3,500			共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入	▲200	+1,000							(10/24-11/7)
ETF買入				+100					0% 全取 1,800億
J-REIT買入									14:30
被災地金融機関支援			▲100	+200					共通担保(本店)(固定金利)・即日
貸出									(10/20-10/21)
国債補完供給									0% 全取 22億
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲25,400		+10,800		▲4,700		+3,000		
当座預金残高	3,129,400		3,140,200		3,135,500		3,138,500		
準備預金残高	2,804,300								
積み終了先	2,314,800								共通担保(本店) 22
超過準備	2,309,000								共通担保(全店) 4,231
非準備預金残高	325,100								国債買現先 0
準備預金進捗率	98.6%								CP買現先 0
平均	16.1%		予想込増減 +10,800		予想込増減 ▲4,700		予想込増減 +3,000		成長基盤強化 71,647
乖離率	82.5%		当預見込 3,140,200		当預見込 3,135,500		当預見込 3,138,500		被災地金融機関支援 4,880
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,153,500
10/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 29,500
10/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,100

	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	-0.040	-0.085
ビッド	-	0.000
出来値	-	-

10/19 時点のマナターベース(単位:億円) **4,163,700**

(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	回数	最高利回	平均利回
10/20	641(3M)	-0.2493%	-0.2545%
10/18	640(1Y)	-0.3080%	-0.3219%
10/13	639(3M)	-0.2735%	-0.2925%

10/19 のコール市場残高(前日比)		
合計	85,114	+5,648
有担	19,121	-78
無担	65,993	+5,726

*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	-0.055	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.230	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.035	-	-	-0.013	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.086	-0.086	-	-0.090	-0.095	-0.099	-0.100	-	-0.157	-0.225	-0.232

§ 10/21 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。
共通担保オペはノーオペを予想する。

10/21 の予定(国内)

15:35 黒田総裁、挨拶(全国信用組合大会)
17:00 黒田総裁、講演(ジャパン・サミット2016)

10/21 の予定(海外)

欧 ユーロ圏消費者信頼感(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	+10,800	3,140,200	+3,140,200	-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
2016/10/24 ~ 2016/11/7	8,000	1,800	1,800	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

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
2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	- 札割れ
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%

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					0.910%	固定金利
10/14 ~ 10/20		0	0	0.900%	固定金利	- 応れなし

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