

# DAILY SIGNAL

平成28年10月21日(金)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 10/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは233兆1,000億円だった。  
週末とな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～▲0.03%のレンジで取引された。  
調達一巡後も▲0.03%台の出合が見られる堅調な地合いだった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,331,000	+2,331,000

(単位:億円)

	日銀速報 10/21(金)		日銀予想 10/24(月)		当社需給予想 10/25(火) 10/26(水)				10/21のオペ結果 9:20 ノオベ 10:10 国庫短期証券買入(10/25-) +0.012%按分(46.6%) 25,001億 国債買入(10/25-) (残存1年以下) +0.014%按分(91.9%) 700億 (残存5年超10年以下) +0.001%按分(14.7%) 4,107億 (物価連動債) ▲0.230円(72.9%) 250億 11:50 国債補充供給(10/21-10/24) ▲0.500% 全取 251億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
	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	
券	▲1,800		▲300		+0		▲1,000		
財政	+2,700		▲9,000		+3,000		+2,000		
過不足	+900		▲9,300		+3,000		+1,000		
金融調節									
国債買入		+11,500			+5,100				
国庫短期証券買入					+25,000				
国債買現先									
共通担保(本店)			▲2,000	+1,800					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲600	+3,500					
社債等買入									
ETF買入		+100							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援	▲100	+200							
貸出									
国債補充供給		▲300	+300						
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	+11,800		▲6,300		+33,100		+1,000		
当座預金残高	3,141,200		3,134,900		3,168,000		3,169,000		
準備預金残高	2,826,500								
積み終了先	2,345,700								
超過準備	2,342,500								
非準備先残高	314,700								
準備預金進捗率	99.3%								
平均	25.8%		予想込増減 ▲6,300		予想込増減 +33,100		予想込増減 +1,000		
乖離率	73.5%		当預見込 3,134,900		当預見込 3,168,000		当預見込 3,169,000		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,153.500  
10/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 14.100  
10/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	T/N	T+2
無担 ユーロ円 CP現先 レボG.C		
オファー	-0.030	-0.100
ビッド	-0.040	0.000
出来値	-	-

10/20 時点のマナターベース(単位:億円) 4,139,800

(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
10/20	641(3M)	-0.2493%	-0.2545%
10/18	640(1Y)	-0.3080%	-0.3219%
10/13	639(3M)	-0.2735%	-0.2925%

10/20 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	79,452	19,177	60,275
	-5.662	+56	-5.718

\*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	-	-	-0.035	-0.035	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.030	0.002	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.035	-	-	-0.034	-0.017	-	-	-	-0.025	-	-
東京レボレート	-0.085	-0.085	-	-0.093	-0.095	-0.099	-0.101	-	-0.155	-0.225	-0.232

## § 10/24 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。  
共通担保オペはノオベを予想する。

## 10/24 の予定(国内)

8:50 貿易統計(9月)  
10:00 金融システムレポート(10月号)  
日銀営業毎旬報告(10月20日現在)

## 10/24 の予定(海外)

米 NY連銀総裁講演  
セントルイス連銀総裁講演  
ハウエルFRB理事講演

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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオベ	▲6,300	3,134,900	+3,134,900	-0.060	-0.035	-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

## \*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
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		1	1	0.910%	固定金利	- 1.00
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