DAILY SIGNAL

平成28年10月24日(月)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 10/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは233兆9,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.035%の出合いから始まった。
その後は▲0.055～▲0.03%のレンジで取引された。
調達一巡後は▲0.04%台の出合が見られ、前日に比べ弱めの地合いであった。

	即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
8:00	－	－	2,339,000	+2,339,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想			
	10/24(月)		10/25(火)		10/26(水)		10/27(木)	
券	▲500		▲500		▲1,000		▲1,000	
財政	▲8,900		+11,000		+2,000		▲13,000	
過不足	▲9,400		+10,500		+1,000		▲14,000	
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				+5,200				
国庫短期証券買入				+25,100				
国債買現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)	▲2,000	+1,800						
CP買現先								
CP等買入	▲600	+3,500	▲400					
社債等買入			▲300					
ETF買入								
J－REIT買入								
被災地金融機関支援貸出								
国債補完供給	+300	▲100	+100					
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	▲6,500		+40,200		+1,000		▲14,000	
当座預金残高	3,134,700		3,174,900		3,175,900		3,161,900	
準備預金残高	2,815,300		共通担保オペ当社予想					
積み終了先	2,334,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ	
超過準備	2,334,600							
非準預先残高	319,400							
準備預金進捗率	99.5%							
平均	29.0%		予想込増減	+40,200	予想込増減	+1,000	予想込増減	▲14,000
乖離率	70.4%		当預見込	3,174,900	当預見込	3,175,900	当預見込	3,161,900

10/24 のオペ結果

9:20
ノーオペ
10:10
ノーオペ
11:50
国債補完供給(10/24-10/25)
▲0.500% 全取 88億

12:50
ノーオペ
13:00
ノーオペ

共通担保(本店)	0
共通担保(全店)	4,021
国債買現先	0
CP買現先	0
成長基盤強化	71,647
被災地金融機関支援	5,051
ロンバート残高	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,153,500
10/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 11,700
10/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オファー	−0.030	－	−0.100	−0.095
ビッド	−0.050	－	0.000	−0.085
出来値	－	－	－	－

10/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,153,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	10/20
長期国債	202	282	346
CP等	2.2	2.2	1.9
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	10.1
J－REIT	0.18	0.27	0.34
貸出支援基金	25	31	36
国庫短期証券	49	43	54
その他とも資産計	300	383	459
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	313
その他とも負債・純資産計	300	383	459

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%

10/21 のコール市場残高(前日比)

合計	78,682	−770
有担	18,901	−276
無担	59,781	−494

*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	−0.065	－	－	−0.035	－	－	－	－	－	－	－
最高	0.001	－	－	−0.005	－	－	－	－	－	－	－
加重平均	−0.040	−0.030	－	−0.030	−0.035	－	−0.015	－	－	－	－
東京レポ・レート	−0.085	−0.088	－	−0.093	−0.095	−0.100	−0.102	－	−0.155	−0.225	−0.232

§ 10/25 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。

10/25 の予定(国内)
10月の月例経済報告(内閣府)
月例経済報告関係閣僚会議
10:00 全国財務局長会議(財務省)

10/25 の予定(海外)
米 10月消費者信頼感指数
独 10月のIFO景況感指数

翌営業日の即日オペ予想				
即日オペ金額		当預増減	当預残高	所要対比
◎	ノーオペ	+40,200	3,174,900	+3,174,900

翌営業日の出合いレンジ予想								
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
−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) *当日物

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	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) *当日物

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	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%	1.24
2012/6/1 ～ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
10/20 ～ 10/27	担保範囲内	1	1	0.910%	固定金利	－	1.00
10/14 ～ 10/20	担保範囲内	0	0	0.900%	固定金利	－	応札なし

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