

DAILY SIGNAL

平成28年10月27日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは237兆円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.035%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。調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.055%近辺の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,370,000	+2,370,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/27 のオペ結果
	10/27(木)		10/28(金)		10/31(月)		11/1(火)		
券									9:20
財政		▲1,700		▲1,000		▲400		+0	ノーオペ
過不足		▲12,900		▲500		▲12,400		▲3,000	10:10
金融調節		▲14,600		▲1,500		▲12,800		▲3,000	ノーオペ
	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	11:50
国債買入				+11,700					国債補完供給(10/27-10/28)
国庫短期証券買入									▲0.500% 全取 48億
国債買現先									12:50
共通担保(本店)					▲1,900	+2,700			ノーオペ
共通担保(全店)									13:00
CP買現先									共通担保(全店)(固定金利)
CP等買入	▲200		▲200			+3,500			(10/31-11/14)
社債等買入									0% 全取 2,660億
ETF買入		+700							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+400	▲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		▲13,800	+10,100		▲8,500		▲3,000		
当座預金残高		3,160,700	3,170,800		3,162,300		3,159,300		
準備預金残高		2,848,200							
積み終了先		2,371,000							共通担保(本店) 0
超過準備		2,370,300							共通担保(全店) 4,021
非準備先残高		312,500							国債買現先 0
準備預金進捗率		99.7%							CP買現先 0
平均		38.7%	予想込増減	+10,100	予想込増減	▲8,500	予想込増減	▲3,000	成長基盤強化 71,647
乖離率		61.0%	当預見込	3,170,800	当預見込	3,162,300	当預見込	3,159,300	被災地金融機関支援 5,051
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,153.500
10/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,600
10/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

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

(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
10/27	642(3M)	-0.2456%	-0.2568%
10/20	641(3M)	-0.2493%	-0.2545%
10/18	640(1Y)	-0.3080%	-0.3219%

10/26 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
10/26	84,059	+519	-500
10/25	18,482	-	-
10/24	65,577	+1,019	-

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

10/26 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,189,000**

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	-0.030	-	-0.036	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.010	-	-0.015	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.044	-0.016	-	-0.028	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.087	-0.089	-	-0.093	-0.095	-0.099	-0.102	-	-0.154	-0.225	-0.232

§ 10/28 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。

10/28 の予定(国内)

8:30 9月の完全失業率(総務省)
9月全国の消費者物価指数(総務省)

10/28 の予定(海外)

米 7～9月のGDP1次速報
欧 10月の消費者信頼感

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	+10,100	3,170,800	+3,170,800	-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	按分率	倍率
2016/10/31 ~ 2016/11/14	8,000	2,660	2,660	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

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	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	按分率	平均レート	按分率	倍率
10/27 ~ 11/4	担保範囲内	0	0	0.900%	固定金利	-	応札なし
10/20 ~ 10/27	担保範囲内	1	1	0.910%	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