

DAILY SIGNAL

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

§ 10/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは239兆円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.035%の出しからスタートした。
その後は▲0.05～▲0.03%のレンジで取引され、調達一巡後はビッドが薄くなり、
▲0.055%の出し合い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	-	-	2,390,000	+2,390,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/28 のオペ結果
	10/28(金)		10/31(月)		11/1(火)		11/2(水)		
券	▲1,000		+600		+0		+0		9:20
財政	+1,300		▲16,200		▲3,000		+0		ノーオペ
過不足	+300		▲15,600		▲3,000		+0		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	国庫短期証券買入(11/1-)
国債買入	+11,700								▲0.009%按分(72.6%) 10,001億
国庫短期証券買入									国債買入(11/1-)
国債買現先									(残存5年超10年以下)
共通担保(本店)									+0.011%按分(80.2%) 4,106億
共通担保(全店)			▲1,900 +2,700						(変動利付債)
CP買現先									▲0.010円(36.4%) 1,005億
CP等買入	▲200		▲2,200 +3,500						11:50
社債等買入									国債補完供給(10/28-10/31)
ETF買入									▲0.500% 全取 38億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+100								ノーオペ
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	+11,900		▲13,000		+12,100		+0		
当座預金残高	3,172,600		3,159,600		3,171,700		3,171,700		
準備預金残高	2,860,300								共通担保(本店)
積み終了先			ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
超過準備	2,390,500								国債買現先
非準備先残高	312,300								CP買現先
準備預金進捗率	99.7%								成長基盤強化
平均	48.4%		予想込増減 ▲13,000		予想込増減 +12,100		予想込増減 +0		被災地金融機関支援
乖離率	51.4%		当預見込 3,159,600		当預見込 3,171,700		当預見込 3,171,700		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,153,000
10/31 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 5,600
10/31 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	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	-0.095
ビッド	-0.050	-
出来値	-	-
	0.000	-0.085

(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	回数	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%

10/27 のコール市場残高(前日比)

	合計	85,376	+1,317
有担	19,292	+810	
無担	66,084	+507	

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

10/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,176,900**

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.060	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.043	-0.015	-	-0.033	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.087	-0.091	-	-0.092	-0.094	-0.099	-0.102	-	-0.154	-0.225	-0.232

§ 10/31 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。

10/31 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(11月1日まで)
8:50 9月の鉱工業生産速報(経産省)
19:30 10月の日銀当座預金増減要因と金融調節実績速報(日銀)

10/31 の予定(海外)

米 9月の個人消費支出
欧 7～9月のGDP速報
9月のCPI速報

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出し合いレンジ予想								
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	▲13,000	3,159,600	+3,159,600	-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
2016/10/31 ~ 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	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	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