

DAILY SIGNAL

平成28年10月31日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/31 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは237兆1,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.035%の出合いから始まり、
その後は▲0.05%台で出合いが散見され、一部▲0.04%の出合いも見られた。
調達一巡後はヒッドが薄くなり、▲0.06~▲0.07%台で取引された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,371,000	+2,371,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/31 のオペ結果
	10/31(月)		11/1(火)		11/2(水)		11/4(金)		
券	+500		▲100		+0		+0		9:20
財政	▲15,700		▲700		+0		+2,000		ノーオペ
過不足	▲15,200		▲800		+0		+2,000		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	国債買入(11/2-)
国債買入				+5,300		+11,200			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+10,000					▲0.001%按分(82.2%) 4,004億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)	▲1,900	+2,700							▲0.003%按分(99.2%) 4,208億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先									▲0.009%按分(17.7%) 1,914億
CP等買入	▲2,200	+3,500							(残存25年超)
社債等買入									▲0.014%按分(48.7%) 1,107億
ETF買入		+500							11:50
J-REIT買入									国債補完供給(10/31-11/1)
被災地金融機関支援									▲0.500% 全取 405億
貸出									12:50
国債補完供給		▲400	+400						ノーオペ
米ドル供給用担保国債供給									13:00
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									13:50
									国債補完供給(10/31-11/1)
									▲0.500% 全取 6億
当座預金増減	▲13,000		+14,900		+11,200		+2,000		
当座預金残高	3,159,600		3,174,500		3,185,700		3,187,700		
準備預金残高	2,839,800								共通担保(本店)
積み終了先	2,371,000								共通担保(全店)
超過準備	2,371,000								国債買現先
非準備先残高	319,800								CP買現先
準備預金進捗率	99.8%								成長基盤強化
平均	51.6%		予想込増減	+14,900	予想込増減	+11,200	予想込増減	+2,000	被災地金融機関支援
乖離率	48.1%		当預見込	3,174,500	当預見込	3,185,700	当預見込	3,187,700	ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,155,200
11/1 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 5,300
11/1 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	-0.035	-	-0.100	-0.095
ヒッド	-0.050	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

10/28 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,189,900

(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%

10/28 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	90,646	+5,270	-367
	18,925	-	+5,637
	71,721	-	-

*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	-	-	-0.036	-0.020	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.015	-0.015	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.047	-0.005	-	-0.026	-0.018	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.089	-0.088	-	-0.092	-0.094	-0.099	-0.102	-	-0.154	-0.225	-0.232

§ 11/1 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.07~+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。

11/1 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(2日目)
黒田日銀総裁会見
展望レポート

11/1 の予定(海外)

米 FOMC(11月2日まで)
10月ISM製造業指数

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	+14,900	3,174,500	+3,174,500	-0.070	-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

*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% 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