

DAILY SIGNAL

平成28年11月1日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは239兆1,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出合いから始まり、
その後は▲0.06～▲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、▲0.05～▲0.06%のレンジで出合いが見られた。
本日の日銀金融政策決定会合では金融政策の現状維持が決定された。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,391,000	+2,391,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/1 のオペ結果
	11/1(火)		11/2(水)		11/4(金)		11/7(月)		
券	▲100		▲700		+0		+1,000		9:20
財政	▲1,800		▲800		+2,000		▲17,000		ノオベ
過不足	▲1,900		▲1,500		+2,000		▲16,000		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	ノオベ
国債買入		+5,300		+11,800					11:50
国庫短期証券買入		+10,000							国債補完供給(11/1-11/2)
国債買現先									▲0.500% 全取 227億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)							▲1,800		ノオベ
CP買現先			▲100						13:00
CP等買入									ノオベ
社債等買入									13:50
ETF買入				+300					国債補完供給(11/1-11/2)
J-REIT買入									▲0.500% 全取 304億
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+400	▲500	+500						
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	+13,300		+11,000		+2,000		▲17,800		
当座預金残高	3,172,900		3,183,900		3,185,900		3,168,100		
準備預金残高	2,861,300		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(本店) 0
積み終了先	2,392,900		ノオベ		ノオベ				共通担保(全店) 4,820
超過準備	2,392,900		ノオベ		ノオベ				国債買現先 0
非準備先残高	311,600		ノオベ		ノオベ				CP買現先 0
準備預金進捗率	99.8%		ノオベ		ノオベ				成長基盤強化 71,647
平均	54.8%		予想込増減	+11,000	予想込増減	+2,000	予想込増減	▲9,800	被災地金融機関支援 5,051
乖離率	44.9%		当預見込	3,183,900	当預見込	3,185,900	当預見込	3,176,100	ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,155,200
11/2以降の残り積み立て額(残り所要)積数 5,000
11/2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
ビッド	-0.050	0.000
出来値	-	-

10/31 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,176,300

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

10/31のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	79,601	19,887	59,714
	-11,045	+962	-12,007

*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	-0.005	-	-0.036	-0.035	-	0.001	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	-0.025	-0.010	-	0.002	-	-	-	-
加重平均	-0.045	-0.002	-	-0.034	-0.029	-0.020	0.002	-	-	-	-
東京レボレート	-0.089	-0.090	-	-0.092	-0.095	-0.099	-0.102	-	-0.153	-0.225	-0.233

§ 11/2 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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされよう。

11/2 の予定(国内)

未定 黒田日銀総裁会見要旨(11月1日)
10:00 日銀営業毎旬報告(10月31日現在)
14:00 展望レポート(10月、全文)

11/2 の予定(海外)

米 FOMCの結果
週間のMBA住宅ローン申請指数
ADP雇用統計(10月)

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	+11,000	3,183,900	+3,183,900	-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
2016/10/31 ~ 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%
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
10/27 ~ 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