

DAILY SIGNAL

平成28年11月7日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは238兆8,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.04%の合出から始まり、その後は▲0.055～▲0.035%のレンジで取引された。調達一巡後は▲0.06%近辺での合出となった。
また、試取りの動きが見られ、+0.001%での合出が散見された。

(単位: 億円)

	即日オペ種類	オフ額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,388,000	+2,388,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/7 のオペ結果
	11/7(月)		11/8(火)		11/9(水)		11/10(木)		
券	+1,500		+1,300		+0		+0		9:20 ノオペ 10:10 国債買入(11/9-) (残存1年以下) +0.017%按分(30.0%) 700億 (残存1年超3年以下) +0.003%按分(5.8%) 4,007億 (残存3年超5年以下) +0.007%按分(62.0%) 4,204億 11:50 国債補完供給(11/7-11/8) ▲0.500% 全取 436億 12:50 ノオペ 13:00 ノオペ
財政	▲19,700		+4,900		+2,000		▲48,000		
過不足	▲18,200		+6,200		+2,000		▲48,000		
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				+7,800		+8,900			
国庫短期証券買入				+10,000					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲1,800	+1,400							
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲200						
社債等買入									
ETF買入		+200		+400					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+100	▲400	+400						
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	▲19,100		+24,600		+10,900		▲48,000		
当座預金残高	3,167,100		3,191,700		3,202,600		3,154,600		
準備預金残高	2,848,600								
積み終了先	2,384,500								
超過準備	2,384,500								
非準備預金残高	318,500								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	74.2%		予想込増減	+24,600	予想込増減	+10,900	予想込増減	▲48,000	
乖離率	25.7%		当預見込	3,191,700	当預見込	3,202,600	当預見込	3,154,600	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,170,600
11/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,800
11/8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	-0.035	-
レボ	-0.100	-0.125
ビッド	-0.050	-
出来値	-	-
CP現先	0.000	-0.105

11/4 時点のマネターベース(単位: 億円) **4,203,500**

(参考)日銀B/S(単位: 兆円)	14年末実績	15年末実績	10/31
長期国債	202	282	348
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	10.2
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	55
その他とも資産計	300	383	463
銀行券	93	98	97
当座預金	178	253	316
その他とも負債・純資産計	300	383	463

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
11/2	643(3M)	-0.2568%	-0.2623%
10/27	642(3M)	-0.2456%	-0.2568%
10/20	641(3M)	-0.2493%	-0.2545%

11/4のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
11/4のコール市場残高(前日比)	96,090	+2,802	-420
	17,968	-	+3,222
	78,122	-	-

*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	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.044	0.000	-	-0.027	-	-	0.000	-	-	-	-
東京レボレート	-0.102	-0.106	-	-0.096	-0.096	-0.100	-0.102	-	-0.152	-0.225	-0.233

§ 11/8 オフタ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。
共通担保オペはノオペを予想する。

11/8 の予定(国内)

14:00 9月の景気動向指数速報(内閣府)
9月の消費活動指数(日銀)

11/8 の予定(海外)

米 大統領選挙
米議会の上下両院選挙

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
◎	ノオペ	+24,600	3,191,700	+3,191,700	-0.070	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-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	オフ額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/10/31 ~ 2016/11/4	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

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オフ額	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	オフ額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
11/4 ~ 11/10	担保範囲内	0	0	0.920%	固定金利	-	応札なし
10/27 ~ 11/4	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