

DAILY SIGNAL

§ 11/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは240兆6,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出合から始まり、その後は
▲0.055～▲0.035%のレンジで取引された。調達一巡後は▲0.065%近辺での
出合が散見されて引けた。

平成28年11月8日(火)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,406,000	+2,406,000

(単位:億円)

	日銀速報 11/8(火)		日銀予想 11/9(水)		当社需給予想 11/10(木) 11/11(金)				11/8 のオペ結果 9:20 ノーオペ 10:10 ノーオペ 10:40 米ドル資金供給(11/10-11/17) 貸付利率0.910% 1百万米ドル CP等買入(11/11-) ▲0.001%按分(78.9%) 2,950億 11:50 国債補完供給(11/8-11/9) ▲0.500% 全取 384億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
					11/10(木)		11/11(金)		
券	+1,400		+800		+0		+0		
財政	+4,400		+100		▲48,000		+1,000		
過不足	+5,800		+900		▲48,000		+1,000		
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		+9,000					
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)									
CP買現先	▲200		▲200					+3,000	
CP等買入									
社債等買入									
ETF買入		+400		+400					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援 貸出									
国債補完供給	+400	▲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	+23,800		+10,500		▲48,000		+4,000		
当座預金残高	3,190,900		3,201,400		3,153,400		3,157,400		
準備預金残高	2,863,200				共通担保オペ当社予想				
積み終了先	2,401,100		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		
超過準備	2,401,100								
非準備預金残高	327,700								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	77.4%		予想込増減	+10,500	予想込増減	▲48,000	予想込増減	+4,000	
乖離率	22.5%		当預見込	3,201,400	当預見込	3,153,400	当預見込	3,157,400	
								共通担保(本店) 0 共通担保(全店) 4,420 国債買現先 0 CP買現先 0 成長基盤強化 71,647 被災地金融機関支援 5,051 ロンバード残高 0	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,170,600
11/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,400
11/9 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	-0.035	-	-0.100	-0.100
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

11/7 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,182,900

(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
11/8	644(6M)	-0.2947%	-0.3066%
11/2	643(3M)	-0.2568%	-0.2623%
10/27	642(3M)	-0.2456%	-0.2568%

11/7 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	88,471	18,335	70,136
	-7,619	+367	-7,986

*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	-0.075	-	-	-0.036	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.044	-	-	-0.016	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.103	-0.105	-	-0.097	-0.097	-0.100	-0.104	-	-0.150	-0.225	-0.233

§ 11/9 オペ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。

11/9 の予定(国内)

8:50 9月の国際収支(財務省)
10月の対外及び対内証券売買契約等の状況
(財務省)

11/9 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数

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
◎ ノーオペ	+10,500	3,201,400	+3,201,400	-0.070	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040
				～	～	～	～	～	～	～
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

共通担保資金供給(全店)								*当日物								共通担保資金供給(本店)								*当日物							
期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	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	*	2016/10/20 ～ 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				
2016/10/31 ～ 2016/11/14		8,000	2,660	2,660	0.00%	固定金利	－	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				
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																							
								米ドル資金供給オペ																							
期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率														
11/10 ～ 11/17		担保範囲内		1	0.910%	固定金利	－	1.00	11/4 ～ 11/10		担保範囲内		0	0	0.920%	固定金利	－	応なし													

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