

DAILY SIGNAL

平成28年11月9日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは241兆4,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.045%の落ちから始まり、その後は▲0.06～▲0.035%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.07%付近で調整程度の落ち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	-	-	2,414,000	+2,414,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/9 のオペ結果
	11/9(水)		11/10(木)		11/11(金)		11/14(月)		
券	+800		+200		+0		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(11/11-) (残存5年超10年以下) ▲0.009%按分(46.9%) 4,104億 (物価連動債) ▲0.130円按分(40.0%) 250億 11:50 国債補完供給(11/9-11/10) ▲0.500%全取 901億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+200		▲49,600		+1,000		▲18,000		
過不足	+1,000		▲49,400		+1,000		▲17,000		
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		+9,000				+4,400			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲2,700		
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲300						
社債等買入									
ETF買入		+400							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+400	▲900	+900						
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	+9,700		▲48,800		+8,400		▲19,700		
当座預金残高	3,200,600		3,151,800		3,160,200		3,140,500		
準備預金残高	2,870,400								
積み終了先	2,409,700								
超過準備	2,409,700								
非準備先残高	330,200								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	80.6%		予想込増減 ▲48,800		予想込増減 +8,400		予想込増減 ▲11,700		
乖離率	19.3%		当預見込 3,151,800		当預見込 3,160,200		当預見込 3,148,500		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,170,600

11/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,900

11/10 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	-
レボ	-	-0.100
CP	-0.100	-0.100
ETF	-0.050	-
レボ	-	-0.090
出来値	-	-

11/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,205,300**

(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%

11/8 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	88,953	+482	
有担	18,722	+387	
無担	70,231	+95	

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.049	0.000	-	-	-0.010	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.101	-0.094	-	-0.098	-0.097	-0.100	-0.105	-	-0.149	-0.225	-0.233

§ 11/10 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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされよう。

11/10 の予定(国内)

8:50 10月31日～11月1日の金融政策決定会合
における主な意見(日銀)

11/10 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
セントルイス連銀総裁の講演

10月のマネーストック(日銀)

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	▲48,800	3,151,800	+3,151,800	-0.070	-0.040	-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	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	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 ～ 2016/11/14	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

*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
11/10 ～ 11/17	担保範囲内	1	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	- 応れなし

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