DAILY SIGNAL

平成28年11月10日(木) 上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 11/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは238兆7.000億円だった。 無担保コールのN物は、朝方▲0.045%の出合から始まり、その後は ▲0.06~▲0.035%のレンジで取引された。昨日に引き続き調達意欲は弱く、 一巡後は▲0.07%近辺で調整程度の出合が散見されて引けた。

		即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
I	8:00	1	-	2,387,000	+2,387,000
I					
ſ					

(単位:億円)

	日銀	速報	日銀予想			当社需給予想				11/10 のオペ結果			
	11/10	0(木)	11/1	1(金)	11/14	4(月)	11/1	5(火)	9:20				
券		+300		+0		+1,000		+1,000	ノーオペ				
財政		▲ 49,900 +5,400				▲18,000		▲ 6,000					
過不足		▲ 49,600		+5,400		▲ 17,000		▲ 5,000	00 ノーオペ				
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	<u>11:50</u>				
国債買入				+4,500					国債補完供給(11/	10-11/11)			
国庫短期証券買入									▲0.500% 全取	. 49億			
国債買現先													
共通担保(本店)									<u>12:50</u> ノーオペ				
共通担保(全店)					▲ 2,700	+1,900			ノーオペ				
CP買現先									13:00				
CP等買入	▲300		▲800	+3,000					共通担保(全店)(固	国定金利〉			
社債等買入									(11/14-11/	28)			
ETF買入				+700					0% 全取 1,90)1億			
J-REIT買入													
被災地金融機関支援													
貸出													
国債補完供給	+900	▲ 100	+100										
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													
W this var A limiter		4 40 400		. 10 000		4 1 7 000		4 5 000					
当座預金増減		▲ 49,100		+12,900		▲ 17,800		▲ 5,000					
当座預金残高		3,151,500		3,164,400	# 12 TO 10 T	3,146,600		3,141,600	共2511/1/十六)				
準備預金残高		2,861,300	, <u>+</u> °		共通担保才	へ当在予想	, ±°		共通担保(本店)	4 400			
積み終了先		2,399,400	<i>></i> − <i>_A</i> ∧		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)	4,420			
┃		2,399,400 290,200							国債買現先 CP買現先	0			
工作		99.9%							成長基盤強化	71.647			
平均			予想込増減	+12 900	予想込増減	▲ 17 800	予想込増減	▲ 5 000	放 技 基 強 独 化 被災地金融機関支援	5,051			
		16.0%		3.164.400			当預見込		版	0,001			
11・耐平		10.0%	ヨ預兄込	J, 104,400	ヨ阴兄込	J, 140,0UU	ヨ	১, 141,600	ロノハート残局	U			

今 積み期間の所要準備額(積数)

11/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 11/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均)

11/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均)										
	T,	/N	T-	+2						
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C						
オファー	-0.035	-	-0.100	-0.100						
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.085						

2,170,600

1,400

(参	<u>考)日銀B/S(単位:兆円)</u>	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
70	の他とも負債・純資産計	300	383	463

T-Billの入札結果(直近3回)

			平均利回
			-0.2765%
			-0.3066%
11/2	643(3M)	-0.2568%	-0.2623%

11/9 のコール市場残高(前日比)										
合計	91,354	+2,401								
有担	18,776	+54								
無担	72.578	+2.347								

*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	-	_	0.000	-	-	-	-	_	-	-
最高	0.001	_	_	0.120	_	_	_	_	_	_	-
加重平均	-0.050	-0.005	_	0.058	-	-	-	-	-	-	-
東京レポ・レート	-0.095	-0.093	_	-0.099	-0.099	-0.101	-0.106	_	-0.149	-0.225	-0.233

11/11 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。

11/11 の予定(国内)

8:50 10月の企業物価指数(日銀)

11/11 の予定(海外)

11月のミシガン大消費者信頼感速報

	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	
0	ノーオペ	+12,900	3,164,400	+3,164,400	-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	共通担保資金供給(全店)					*当日物	勿		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
2016	/11/14 ~ 2016/11/28	8,000	1,901	1,901	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
2016	3/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	0.00%	固定金利	_	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
2016	/10/24 ~ 2016/11/7	8,000	1,800	1,800	0.00%	固定金利	_	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2016	/10/17 ~ 2016/10/31	8,000	1,861	1,861	0.00%	固定金利	_	札割れ	米ドル資金供給オー	ペ						
2016	/10/11 ~ 2016/10/24	8,000	2,010	2,010	0.00%	固定金利	-	札割れ	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	3/10/7 ~ 2017/1/16	5,000	210	210	0.00%	固定金利	_	札割れ	11/10 ~ 11/17	担保範囲内	1	1	0.910%	固定金利	-	1.00
2016	3/10/3 ~ 2016/10/17	8,000	1,910	1,910	0.00%	固定金利	-	札割れ	11/4 ~ 11/10	担保範囲内	0	0	0.920%	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