

# DAILY SIGNAL

平成28年11月14日(月)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 11/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは237兆6,000億円だった。  
無担保コールON物は、朝方▲0.045%の出合から始まり、その後は▲0.07～▲0.03%のレンジで取引された。先週に引き続き調達意欲は乏しく、一巡後は▲0.08%台での出合も見られて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,376,000	+2,376,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/14 のオペ結果
	11/14(月)		11/15(火)		11/16(水)		11/17(木)		
券	+900		+500		+0		▲1,000		9:20
財政	▲24,500		▲3,300		▲1,000		▲25,000		ノオベ
過不足	▲23,600		▲2,800		▲1,000		▲26,000		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				+11,700					11:50
国庫短期証券買入				+15,000					国債補完供給(11/14-11/15)
国債買現先									▲0.600% 全取 43億
共通担保(本店)	▲2,700	+1,900							12:50
共通担保(全店)			▲600						ノオベ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲500								ノオベ
社債等買入									13:50
ETF買入		+300		+100					国債補完供給(11/14-11/15)
J-REIT買入									▲0.600% 全取 200億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給		▲200		+200					
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	▲24,800		+23,600		▲1,000		▲26,000		
当座預金残高	3,139,400		3,163,000		3,162,000		3,136,000		
準備預金残高	2,839,100		2,832,500		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店)
積み終了先	2,382,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)
超過準備	2,382,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先
非準備先残高	300,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先
準備預金進捗率	99.9%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化
平均	96.8%		予想込増減	+23,600	予想込増減	▲1,000	予想込増減	▲26,000	被災地金融機関支援
乖離率	3.1%		当預見込	3,163,000	当預見込	3,162,000	当預見込	3,136,000	ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,170,600  
11/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200  
11/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	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	-0.050	-
ビッド	-	-
出来値	-	-

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	11/10
長期国債	202	282	352
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	10.3
J-REIT	0.18	0.27	0.35
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	465
銀行券	93	98	97
当座預金	178	253	315
その他とも負債・純資産計	300	383	465

## T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
11/10	645(3M)	-0.2661%	-0.2765%
11/8	644(6M)	-0.2947%	-0.3066%
11/2	643(3M)	-0.2568%	-0.2623%

## 11/11 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	94,470	+103	
有担	18,523	-1,294	
無担	75,947	+1,397	

\*出所:営業毎旬報告  
\*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

11/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,177,300**

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.086	-	-	-0.030	-0.030	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.010	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	0.000	-	-0.023	-0.024	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.094	-0.091	-	-0.096	-0.096	-0.103	-0.107	-	-0.148	-0.225	-0.233

## § 11/15 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.08～+0.001%のレンジで取引されよう。  
共通担保オペはノオベを予想する。

## 11/15 の予定(国内)

未定 黒田総裁記者会見要旨

## 11/15 の予定(海外)

米 11月のNY連銀製造業景況感指数  
FRB副議長講演  
欧 7~9月のGDP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	着地残対比		ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎	ノオベ	+23,600	3,163,000	+3,162,800		-0.080	-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

## 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
2016/11/14 ~ 2016/11/28	8,000	1,901	1,901	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

## \*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% 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