

DAILY SIGNAL

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

§ 10/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは321兆1,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.03%の出合から始まった。週末に引き続き堅調な地合となり
その後は、主に▲0.04%～▲0.025%の水準で出合が見られた。
後場では▲0.05%～▲0.045%で調整程度の出合が散見され引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,211,000	3,211,000

(単位:億円)

	日銀速報 10/10(火)		日銀予想 10/11(水)		当社需給予想				10/10 のオペ結果
					10/12(木)		10/13(金)		
券	+800		+1,000		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲25,300		+900		▲2,000		+67,000		10:10 国債買入(10/12-) (残存1年以下)
過不足	▲24,500		+1,900		▲2,000		+66,000		+0.002% 按分(52.5%)703億 (残存1年超3年以下)
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	▲0.003% 按分(74.7%)2,803億 (残存3年超5年以下)
国債買入				+7,200		+6,800			+0.002% 按分(21.6%)3,008億 (物価連動債)
国庫短期証券買入				+10,000					+0.100円 按分(25%)251億
国債買現先									11:50 国債補完供給(10/10-10/11)
国債売現先									▲0.500% 全取 312億
共通担保(本店)	▲2,400	+2,000							12:50 ノーオペ
共通担保(全店)									13:00 ノーオペ
CP買現先			▲300	+3,000					13:50 国債補完供給(10/10-10/11)
CP等買入	▲500			+800					▲0.500% 全取 1億
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援 貸出									
国債補完供給	+300	▲300	+300						
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	▲25,400		+22,900		+4,800		+66,000		
当座預金残高	3,614,300		3,637,200		3,642,000		3,708,000		
準備預金残高	3,211,900								共通担保(全店) 4,625
積み終了先	3,211,700		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先 0
超過準備	3,211,700								CP買現先 0
非準備先残高	402,400								成長基盤強化 92,686
準備預金進捗率	99.9%								被災地金融機関支援 5,235
平均	83.3%		予想込増減	+22,900	予想込増減	+4,800	予想込増減	+66,000	ロンハート残高 0
乖離率	16.6%		当預見込	3,637,200	当預見込	3,642,000	当預見込	3,708,000	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,921,600
10/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 600
10/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.025	-	-0.100	-0.105
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

10/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,695,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	9/30
長期国債	282	361	404
CP等	2.2	2.3	1.9
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	15.8
J-REIT	0.27	0.36	0.43
貸出支援基金	31	41	48
国庫短期証券	43	50	32
その他とも資産計	383	476	513
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	369
その他とも負債・純資産計	383	476	513

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
10/5	713 (3M)	-0.1617%	-0.1685%
10/4	712 (6M)	-0.1603%	-0.1643%
9/28	711 (3M)	-0.1550%	-0.1652%

10/6 のコール市場残高(前日比)

合計	104,896	+6,578
有担	21,965	+1,086
無担	82,931	+5,492

*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	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.029	-	-	-0.031	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.094	-0.094	-	-0.103	-0.103	-0.107	-0.109	-	-0.120	-0.130	-0.154

§ 10/11 オファ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。
共通担保オペはノーオペを予想。

10/11 の予定(国内)

8:50 8月の機械受注(内閣府)

10/11 の予定(海外)

米 プラートECB専務理事の講演(NY)
9月19～20日のFOMC議事録
シカゴ連銀総裁の講演

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
◎ ノーオペ	+22,900	3,637,200	+3,637,200	-0.070	-0.050	-0.050	-0.050	-0.045	-0.035	-0.030	-0.010
				～	～	～	～	～	～	～	～
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.080

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2017/10/10 ～ 2017/10/23	8,000	2,035	2,035	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/10/2 ～ 2017/10/16	8,000	2,250	2,250	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/25 ～ 2017/10/10	8,000	2,386	2,386	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/19 ～ 2017/10/2	8,000	4,300	4,300	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/19 ～ 2017/12/25	5,000	120	120	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/11 ～ 2017/9/25	8,000	1,985	1,985	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/4 ～ 2017/9/19	8,000	1,360	1,360	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/28 ～ 2017/9/11	8,000	1,932	1,932	0.00%	固定金利	-	札割れ

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2017/5/24 ～ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	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
2012/6/5 ～ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
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
10/5 ～ 10/13	担保範囲内	1	1	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
9/28 ～ 10/5	担保範囲内	400	400	1.630%	固定金利	0.0%	1.00

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