

DAILY SIGNAL

平成28年10月24日(火)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 10/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは326兆4,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.04%の出合から始まり、
その後は▲0.05～▲0.035%の水準で取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06%台半ばの出合が見られた。
同加重平均金利は前日比+0.001%の▲0.041%となった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,264,000	3,264,000

日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/24 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(10/26-11/2) 貸付利率 1.650% 0百万米ドル 11:50 国債補完供給(10/24-10/25) ▲0.500% 全取 1億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ	
10/24(火)		10/25(水)		10/26(木)		10/27(金)			
▲900		▲600		▲1,000		▲2,000			
▲2,600		+4,700		▲3,000		+1,000			
▲3,500		+4,100		▲4,000		▲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		+10,000							
国庫短期証券買入		+5,000							
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲200	+1,000					
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	+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									
当座預金増減	+11,400		+4,700		▲4,000		▲1,000		
当座預金残高	3,693,100		3,697,800		3,693,800		3,692,800		
準備預金残高	3,262,800		共通担保オペ当社予想						
積み終了先	3,260,800		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		
超過準備	3,260,200								
非準備先残高	430,300								
準備預金進捗率	99.7%								
平均	29.0%		予想込増減	+4,700	予想込増減	▲4,000	予想込増減	▲1,000	
乖離率	70.7%		当預見込	3,697,800	当預見込	3,693,800	当預見込	3,692,800	
								共通担保(全店) 3,320	
								国債買現先 0	
								CP買現先 0	
								成長基盤強化 92,686	
								被災地金融機関支援 5,088	
								ロンハート残高	

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,019,500
10/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 9,300
10/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.040	-	-0.100	-0.105
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	10/20
長期国債	282	361	409
CP等	2.2	2.3	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	16.1
J-REIT	0.27	0.36	0.44
貸出支援基金	31	41	48
国庫短期証券	43	50	29
その他とも資産計	383	476	515
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	370
その他とも負債・純資産計	383	476	515

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
10/19	716 (3M)	-0.1861%	-0.1924%
10/18	715 (1Y)	-0.1618%	-0.1687%
10/12	714 (3M)	-0.1768%	-0.1865%

10/23 のコール市場残高(前日比)

合計	有担	無担
89,698	21,604	68,094
-5,866	-1,322	-4,544

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

10/23 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,738,000

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	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.041	-	-	-0.034	-0.040	0.000	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.098	-0.097	-	-0.112	-0.113	-0.113	-0.116	-	-0.135	-0.135	-0.161

§ 10/25 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.075～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オベはノーオペを予想。

10/25 の予定(国内)

未定 10月の月例経済報告(内閣府)

10/25 の予定(海外)

米 週間MBA住宅ローン申請件数
9月の新築住宅販売件数

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	S6M	S1Y			
◎ ノーオペ	+4,700	3,697,800	+3,697,800	-0.075	-0.045	-0.045	-0.045	-0.045	-0.035	-0.030	-0.010	-0.010			
				～	～	～	～	～	～	～	～	～			
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.080	0.100			
共通担保資金供給(全店)				*当日物											
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レート	按分率	倍率
2017/10/23 ～ 2017/11/6	8,000	1,630	1,630	0.00%	固定金利	－	札割れ	2017/5/24 ～ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	－	札割れ
2017/10/18 ～ 2017/10/19	1,000	51	51	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
2017/10/16 ～ 2017/10/30	8,000	1,350	1,350	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
2017/10/10 ～ 2017/10/23	8,000	2,035	2,035	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
2017/10/2 ～ 2017/10/16	8,000	2,250	2,250	0.00%	固定金利	－	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2017/9/25 ～ 2017/10/10	8,000	2,386	2,386	0.00%	固定金利	－	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レート	按分率	倍率
2017/9/19 ～ 2017/10/2	8,000	4,300	4,300	0.00%	固定金利	－	札割れ	10/26 ～ 11/2	担保範囲内	0	0	1.650%	固定金利	0.0%	応れなし
2017/9/19 ～ 2017/12/25	5,000	120	120	0.00%	固定金利	－	札割れ	10/19 ～ 10/26	担保範囲内	2	2	1.660%	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