

DAILY SIGNAL

§ 10/25 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは326兆8,000億円だった。
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。

平成28年10月25日(水)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,268,000	3,268,000

(単位:億円)

	日銀速報 10/25(水)		日銀予想 10/26(木)		当社需給予想 10/27(金) 10/30(月)				10/25 のオペ結果
券	▲800		▲1,500		▲2,000				9:20 ノーオペ
財政	+8,800		▲4,700		+1,000				10:10 国債買入(10/27-) (残存1年超3年以下)
過不足	+8,000		▲6,200		▲1,000				(残存3年超5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(19.3%)2,805億
国債買入						+8,800			(残存3年超5年以下)
国庫短期証券買入									+0.002% 按分(26.1%)3,004億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
国債売現先									0.000% 按分(22.0%)2,005億
共通担保(本店)									(残存25年超)
共通担保(全店)									+0.002% 按分(58.3%)1,003億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲200		▲300						国債補完供給(10/25-10/26)
社債等買入	▲200	+1,000	▲100				▲1,400		▲0.500% 全取 300億
ETF買入									12:50
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									13:00
貸出									ノーオペ
国債補完供給		▲400	+400						13:50
米ドル供給用担保国債供給									国債補完供給(10/25-10/26)
成長基盤強化支援									▲0.500% 全取 90億
貸出増加支援									
当座預金増減	+8,200		▲6,200		+7,800				
当座預金残高	3,701,300		3,695,100		3,702,900				
準備預金残高	3,266,700		3,266,000		3,265,000				
積み終了先	3,266,000		3,265,000		3,265,000				
超過準備	3,265,000		3,265,000		3,265,000				
非準備先残高	434,600		434,600		434,600				
準備預金進捗率	99.7%		99.7%		99.7%				
平均	32.3%		32.3%		32.3%				
乖離率	67.5%		67.5%		67.5%				

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,019,500
10/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,600
10/26 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	-0.035	-	-0.100	-0.105
ビッド	-0.045	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

10/24 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,750,400

(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%

10/24 のコール市場残高(前日比)

合計	91,383	+1,685
有担	21,763	+159
無担	69,620	+1,526

*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	-0.065	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.041	-	-	-0.039	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.098	-0.096	-	-0.113	-0.113	-0.114	-0.117	-	-0.134	-0.134	-0.162

§ 10/26 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ると予想。

10/26 の予定(国内)

なし

10/26 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
欧 ECB理事会
ECB総裁の会見

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	▲6,200	3,695,100	+3,695,100	-0.070	-0.045	-0.045	-0.045	-0.045	-0.035	-0.030	-0.010
				～	～	～	～	～	～	～	～
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.100

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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
2017/10/18 ～ 2017/10/19	1,000	51	51	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/10/16 ～ 2017/10/30	8,000	1,350	1,350	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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	按分レト	平均レト	按分率	倍率
10/26 ～ 11/2	担保範囲内	0	0	1.650%	固定金利	0.0%	応れなし
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