

DAILY SIGNAL

平成28年10月20日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは326兆3,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.040%の出合からスタート。
その後は、▲0.055～▲0.040%で出合が見られた。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.065%の出合も見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,263,000	3,263,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/20 のオペ結果
	10/20(金)		10/23(月)		10/24(火)		10/25(水)		
券	▲1,100		▲100		+0		▲1,000		9:20 ノオペ
財政	▲8,500		▲22,400		+3,000		+3,000		10:10 国庫短期証券買入(10/24-)
過不足	▲9,600		▲22,500		+3,000		+2,000		+0.003% 按分(31.4%)5,003億
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(10/24-)
国債買入		+4,100				+9,900			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入						+5,000			+0.005% 按分(52.7%)2,805億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
国債売現先									+0.008% 全取3,000億
共通担保(本店)			▲2,000	+1,600					(残存5年超10年以下)
共通担保(全店)									+0.008% 按分(39.4%)4,105億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲400		▲100						国債補完供給(10/20-10/23)
社債等買入			▲100						▲0.500% 全取1,319億
ETF買入									12:50
J-REIT買入									ノオペ
被災地金融機関支援	▲200	+100							13:00
貸出									ノオペ
国債補完供給	+400	▲1,500	+1,500						
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	▲7,100		▲21,600		+17,900		+3,000		
当座預金残高	3,701,300		3,679,700		3,697,600		3,700,600		
準備預金残高	3,266,400		3,263,400		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) 3,725
積み終了先	3,263,400		ノオペ		ノオペ		ノオペ		国債買現先 0
超過準備	3,259,500		ノオペ		ノオペ		ノオペ		CP買現先 0
非準備先残高	434,900		ノオペ		ノオペ		ノオペ		成長基盤強化 92,686
準備預金進捗率	99.5%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		被災地金融機関支援 5,088
平均	22.6%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		ロンハート残高 0
乖離率	76.9%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		
			予想込増減	▲21,600	予想込増減	+17,900	予想込増減	+3,000	
			当預見込	3,679,700	当預見込	3,697,600	当預見込	3,700,600	

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,019,500
10/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 14,700
10/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	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
ビッド	-0.050	0.000
出来値	-	-

10/19 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,763,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	10/10
長期国債	282	361	407
CP等	2.2	2.3	1.8
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	15.9
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	30
その他とも資産計	383	476	513
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	361
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
10/19	716 (3M)	-0.1861%	-0.1924%
10/18	715 (1Y)	-0.1618%	-0.1687%
10/12	714 (3M)	-0.1768%	-0.1865%

10/19 のコール市場残高(前日比)

	合計	93,215	+6,659
有担	21,355	+4,213	
無担	71,860	+2,446	

*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	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.041	-	-	-0.031	0.000	-	-	-	0.380	-	-
東京レボ・レート	-0.099	-0.095	-	-0.112	-0.115	-0.115	-0.117	-	-0.136	-0.137	-0.160

§ 10/23 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。
共通担保オペはノオペを予想。

10/23 の予定(国内)

14:00 17年10月の金融システムレポート(日銀)

10/23 の予定(海外)

米 9月のシカゴ連銀全米活動指数
ユーロ圏 10月の消費者信頼感指数

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
◎ ノオペ	▲21,600	3,679,700	+3,679,700	-0.070	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	*当日物		
					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
2017/10/18 ~ 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	按分レート	*当日物		
					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
10/19 ~ 10/26	担保範囲内	2	2	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
10/13 ~ 10/19	担保範囲内	0	0	1.660%	固定金利	0.0%	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