

DAILY SIGNAL

平成27年9月16日(水)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

9/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは179兆8,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%の出会いから始まり、その後は
0.075~0.076%のレンジで推移した。一部市場参加者による試し取りから0.12%超の
出会いが見られ、加重平均金利は0.091%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,798,000	+1,792,662

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/16 のオペ結果
	9/16(水)		9/17(木)		9/18(金)		9/24(木)		
券	▲1,700		▲3,700		▲2,000		+1,000		9:20
財政	▲500		▲600		+1,000		+50,000		ノーオペ
過不足	▲2,200		▲4,300		▲1,000		+51,000		12:50
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	ノーオペ
国債買入									13:00
国庫短期証券買入									ノーオペ
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,100		
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲300	+5,000					
社債等買入			▲100						
ETF買入									
J-REIT買入		+300							
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給									
成長基盤強化支援			▲2,300	+7,300					
貸出増加支援									
当座預金増減	▲2,300		+5,300		▲1,000		+49,900		
当座預金残高	2,353,900		2,359,200		2,358,200		2,408,100		
準備預金残高	2,152,600								
積み終了先	655,600		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(本店) 0
超過準備	520,300								共通担保(全店) 62,533
非準備先残高	201,300								国債買現先 0
準備預金進捗率	65.6%								CP買現先 0
平均	3.3%		予想込増減 +5,300		予想込増減 ▲1,000		予想込増減 +57,900		成長基盤強化 51,360
乖離率	62.3%		当預見込 2,359,200		当預見込 2,358,200		当預見込 2,416,100		被災地金融機関支援 3,166
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,952,800

9/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 671,300

9/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 23,100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.050	0.060	0.035
ビッド	0.075	-0.010	0.100	0.050
出来値	-	-	-	-

9/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,312,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	9/10
長期国債	142	202	262
CP等	2.2	2.2	2.5
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	6.1
J-REIT	0.14	0.18	0.25
貸出支援基金	9.2	25	29
国庫短期証券	40	49	47
その他とも資産計	224	300	366
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	234
その他とも負債・純資産計	224	300	366

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
9/16	558(1Y)	-0.0161%	-0.0252%
9/10	557(3M)	0.0000%	-0.0032%
9/8	556(6M)	-0.0020%	-0.0080%

9/15 のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
188,110	-14,402	-744
134,508	-744	-13,658

*出所:営業毎報告
*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	0.060	0.072	-	0.068	0.118	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.205	0.120	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.091	0.080	-	0.100	0.118	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.024	0.028	-	0.036	▲0.044	▲0.030	▲0.012	-	0.034	0.040	0.049

9/17 オファターのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台後半で取引されよう。
共通担保オペは期落ちをロールすると予想。

9/17 の予定(国内)

8:50 4-6月の資金循環(日銀)
8月の貿易統計(財務省)

9/17 の予定(海外)

米 FOMCの結果
FRB議長の見聞
4-6月の経常収支

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想								
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	+5,300	2,359,200	+2,359,200	0.020	0.070	0.050	0.050	0.060	0.117	0.118	0.120	0.200
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.140	0.155	0.160	0.170	0.300

共通担保資金供給(全店)				*当日物				共通担保資金供給(本店)				*当日物			
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	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
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	0.10%	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
2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/9/7 ~ 2015/12/7	8,000	580	580	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2015/9/4 ~ 2015/12/15	15,000	8,210	8,210	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/9/1 ~ 2015/12/11	15,000	8,450	8,450	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/8/31 ~ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	0.10%	固定金利	-	札割れ	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
2015/8/28 ~ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	0.10%	固定金利	-	札割れ	9/17 ~ 10/1	担保範囲内	539	539	0.690%	固定金利	-	1.00
2015/8/24 ~ 2015/11/24	8,000	2,691	2,691	0.10%	固定金利	-	札割れ	9/11 ~ 9/17	担保範囲内	4	4	0.650%	固定金利	-	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ありません。今後予告なく変更されることがあります。 上田八木証券株式会社 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