

DAILY SIGNAL

平成27年9月17日(木)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

9/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは181兆1,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%の出合いから始まり、その後は
0.075~0.076%のレンジで推移した。一巡後はビッドは徐々に薄くなったものの、
後場にかけて0.072~0.075%の取引が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,811,000	+1,811,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/17 のオペ結果
	9/17(木)		9/18(金)		9/24(木)		9/25(金)		
券	▲4,000		▲3,900		+1,000		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(9/24-) (残存5年超10年以下) ▲0.003%按分(90.5%) 4003億 (残存10年超25年以下) ▲0.004%按分(77.8%) 2404億 (残存25年超) ▲0.009%按分(42.1%) 1401億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)(固定金利方式) (9/24-12/21) 0.10%(札割れ) 1300億
財政	▲100		+3,900		+50,000		▲1,000		
過不足	▲4,100		+0		+51,000		+0		
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									
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)					▲1,100	+1,300			
CP買現先									
CP等買入	▲300	+5,000	▲1,100						
社債等買入	▲100		▲900						
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出							▲1,000	+1,000	
国債補完供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援	▲2,300	+7,300							
当座預金増減	+5,500		▲2,000		+59,000		+0		
当座預金残高	2,359,400		2,357,400		2,416,400		2,416,400		
準備預金残高	2,156,500		2,156,500		2,156,500		2,156,500		
積み終了先	1,669,500		1,669,500		1,669,500		1,669,500		
超過準備	1,364,900		1,364,900		1,364,900		1,364,900		
非準備先残高	202,900		202,900		202,900		202,900		
準備預金進捗率	88.3%		88.3%		88.3%		88.3%		
平均	6.7%		6.7%		6.7%		6.7%		
乖離率	81.6%		81.6%		81.6%		81.6%		
予想込増減	▲2,000		▲2,000		+59,000		+0		
当預見込	2,357,400		2,357,400		2,416,400		2,416,400		
共通担保オベ当社予想	ノオベ		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
共通担保(本店)	0		0		0		0		
共通担保(全店)	62,533		62,533		62,533		62,533		
国債買現先	0		0		0		0		
CP買現先	0		0		0		0		
成長基盤強化	51,360		51,360		51,360		51,360		
被災地金融機関支援	3,166		3,166		3,166		3,166		
ロンハート残高	0		0		0		0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,952,800
9/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 229,000
9/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 8,200

	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	0.070
ビッド	0.076	-0.010	0.100	0.085
出来値	-	-	-	-

9/16 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,312,100

(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
9/17	559(2M)	-0.0103%	-0.0215%
9/16	558(1Y)	-0.0161%	-0.0252%
9/10	557(3M)	0.0000%	-0.0032%

9/16 のコール市場残高(前日比)		
合計	223,196	+35,086
有担	131,688	-2,820
無担	91,508	+37,906

*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	0.030	0.050	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.079	-	-	0.170	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.022	0.057	-	▲0.068	▲0.045	▲0.029	▲0.008	-	0.034	0.040	0.049

9/18 オファターのオペと市場動向予想

明日の足許金利は6日積みとなり、0.07%台後半まで
やや強含むだろう。共通担保オベはノオベ予想。

9/18 の予定(国内)

8:50 8/6-7の金融政策決定会合議事要旨(日銀)

9/18 の予定(海外)

米 8月の景気先行指数
4-6月の資金循環

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
◎ ノオベ	▲2,000	2,357,400	+2,357,400	0.020	0.040	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	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2015/9/24 ~ 2015/12/21	8,000	1,300	1,300	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
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	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
2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	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
2015/9/7 ~ 2015/12/7	8,000	580	580	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
2015/9/4 ~ 2015/12/15	15,000	8,210	8,210	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ							
2015/9/1 ~ 2015/12/11	15,000	8,450	8,450	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2015/8/31 ~ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	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
2015/8/28 ~ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	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なく、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