

DAILY SIGNAL

平成28年9月14日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは227兆2,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.03%の出合から始まり、
その後は、▲0.085%～▲0.03%のレンジで取引された。
調達一巡後も地合に変化は見られず、引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,272,000	+2,272,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/14 のオペ結果
	9/14(水)		9/15(木)		9/16(金)		9/20(火)		
券	▲300		▲1,000		▲2,000		+0		9:20
財政	▲4,100		▲11,100		+2,000		+41,000		ノーオペ
過不足	▲4,400		▲12,100		+0		+41,000		10:10
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(9/16-)
国債買入		+4,700				+11,400			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									▲0.038%按分(86.3%) 4,002億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.032%按分(40.2%) 4,201億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先									+0.042%按分(89.5%) 2,002億
CP等買入	▲300		▲1,000			+5,000			(残存25年超)
社債等買入	▲100		▲100						+0.030%按分(45.7%) 1,201億
ETF買入									11:50
J-REIT買入									国債補完供給(9/14-9/15)
被災地金融機関支援									▲0.600%全取 3,072億
貸出									12:50
国債補完供給	+200	▲3,600	+3,600						ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノーオペ
						▲8,400	+54,400		13:50
									国債補完供給(9/14-9/15)
									▲0.600%全取 281億
当座預金増減	▲3,500		▲9,600		+62,400		+39,300		
当座預金残高	3,036,900		3,027,300		3,089,700		3,129,000		
準備預金残高	2,725,600		2,723,100		2,723,100		2,723,100		共通担保オペ当社予想
積み終了先	2,273.100		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	2,273.100		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 4,010
非準備先残高	311,300		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		国債買現先 0
準備預金進捗率	100.0%		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		CP買現先 0
平均	96.8%		予想込増減 ▲9,600		予想込増減 +62,400		予想込増減 +47,300		成長基盤強化 71,647
乖離率	3.2%		当預見込 3,027,300		当預見込 3,089,700		当預見込 3,137,000		被災地金融機関支援 5,045
									ロンハート残高 0

今積み期間の所要準備額(積数) 2,149,000
9/15以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
9/15以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.030	-	-0.100	-0.100
ビッド	-	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

9/13時点のマナタリーベース(単位:億円) **4,045,700**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	9/10
長期国債	202	282	342
CP等	2.2	2.2	2.6
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	9.2
J-REIT	0.18	0.27	0.33
貸出支援基金	25	31	33
国庫短期証券	49	43	58
その他とも資産計	300	383	456
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	304
その他とも負債・純資産計	300	383	456

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
9/14	633(1Y)	-0.3219%	-0.3398%
9/8	632(3M)	-0.2645%	-0.2817%
9/7	631(6M)	-0.2566%	-0.2769%

9/13のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	76,824	+187	-
有担	19,313	+770	-
無担	57,511	-583	-

*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	-0.085	-0.070	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.230	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.063	-0.066	-	-0.017	-0.040	0.040	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.100	-0.105	-	-0.110	-0.112	-0.144	-0.145	-	-0.160	-0.225	-0.226	-

9/15 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.085%～▲0.02%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。

9/15の予定(国内)

8:50 前週の対内対外証券売買契約等の状況(財務省)
被災地金融機関支援オペ貸付実施の通知日(9月23日貸付)

9/15の予定(海外)

米 4～6月の経常収支
8月の小売売上高
9月のNY連銀製造業景況感指数

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	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎ ノーオペ	▲9,600	3,027,300	+3,027,300	-0.085	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.060	-0.070	-0.070	
				~	~	~	~	~	~	~	~	~	
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/9/12 ~ 2016/9/26	8,000	1,970	1,970	0.00%	固定金利	札割れ
2016/9/5 ~ 2016/9/20	8,000	1,660	1,660	0.00%	固定金利	札割れ
2016/8/29 ~ 2016/9/12	8,000	1,891	1,891	0.00%	固定金利	札割れ
2016/8/22 ~ 2016/9/5	8,000	1,891	1,891	0.00%	固定金利	札割れ
2016/8/15 ~ 2016/8/29	8,000	1,941	1,941	0.00%	固定金利	札割れ
2016/8/9 ~ 2016/11/28	5,000	150	150	0.00%	固定金利	札割れ
2016/8/8 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	固定金利	札割れ
2016/8/1 ~ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	0.00%	固定金利	札割れ

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
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
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0% 2.70
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6% 2.46
米ドル資金供給オペ						
期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
9/15 ~ 9/23	担保範囲内	2	2	0.900%	固定金利	- 1.00
9/9 ~ 9/15	担保範囲内	1	1	0.900%	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