

DAILY SIGNAL

平成28年9月16日(金)
上田八木短資株式会社 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232兆円だった。
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▲0.08%～▲0.03%のレンジで取引された。
後場においては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	-	-	2,320,000	+2,320,000

(単位:億円)

	日銀速報 9/16(金)		日銀予想 9/20(火)		当社需給予想				9/16 のオペ結果			
	9/21(水)	9/23(金)	9/20(火)		9/21(水)		9/23(金)					
券	▲1,600	▲200	▲200		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ			
財政	+600	+33,200	+33,200		▲1,000		+1,000		10:10 国庫短期証券買入(9/21-)			
過不足	▲1,000	+33,000	+33,000		▲1,000		+0		▲0.016%按分(11.7%) 12,502億			
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(9/21-) (残存1年以下)			
国債買入		+11,600							▲0.045%按分(10.3%) 700億			
国庫短期証券買入						+8,900			(残存1年超3年以下)			
国債買現先						+12,500			+0.002%按分(12.6%) 4,005億			
共通担保(本店)			▲1,700	+4,500					(残存3年超5年以下)			
共通担保(全店)									+0.006%按分(96.2%) 4,208億			
CP買現先									10:40 社債等買入(9/26-)			
CP等買入	▲500	+5,000	▲1,400						▲0.215%按分(24.0%) 1,250億			
社債等買入			▲400						11:50 国債補完供給(9/16-9/20)			
ETF買入		+800		+100					▲0.600%全取 625億			
J-REIT買入									12:50 ノーオペ			
被災地金融機関支援							▲1,000	+800	13:00 ノーオペ			
貸出									13:50 ノーオペ			
国債補完供給	+800	▲600	+600						国債補完供給(9/16-9/20)			
成長基盤強化支援									▲0.600%全取 625億			
貸出増加支援	▲29,400	+54,400							12:50 ノーオペ			
当座預金増減	+41,100	+34,700	+34,700	+20,400	+20,400	▲200			13:00 ノーオペ			
当座預金残高	3,066,900	3,101,600	3,101,600	3,122,000	3,122,000	3,121,800			13:50 ノーオペ			
準備預金残高	2,762,600	共通担保オペ当社予想				共通担保(本店)				0		
積み終り先	2,288,300	ノーオペ				ノーオペ				共通担保(全店)	4,010	
超過準備	1,807,400	ノーオペ				ノーオペ				国債買現先	0	
非準備先残高	304,300	ノーオペ				ノーオペ				CP買現先	0	
準備預金進捗率	97.3%	予想込増減				+34,700	予想込増減	+20,400	予想込増減	▲200	成長基盤強化	71,647
平均	13.3%	当預見込				3,101,600	当預見込	3,122,000	当預見込	3,121,800	被災地金融機関支援	5,045
乖離率	83.9%	当預見込				3,101,600	当預見込	3,122,000	当預見込	3,121,800	ロンハート残高	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,072.900
9/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 56,800
9/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,200

	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
ビッド	-	0.000
出来値	-	-

9/15 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,032,500

(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	回号	最高利回	平均利回
9/15	634(3M)	-0.3363%	-0.3549%
9/14	633(1Y)	-0.3219%	-0.3398%
9/8	632(3M)	-0.2645%	-0.2817%

9/15 のコール市場残高(前日比)			
合計	77,879	+205	
有担	19,339	-998	
無担	58,540	+1,203	

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.060	-0.065	-	-0.035	-	-	-0.035	-	-	-	-
東京レボレート	-0.090	-0.087	-	-0.100	-0.134	-0.139	-0.142	-	-0.163	-0.225	-0.227

9/20 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.08%～▲0.02%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想。

9/20 の予定(国内)

8:50 8月の公社債投資家別売買状況(日証協)
日銀金融政策決定会合(21日まで)

9/20 の予定(海外)

米 8月の住宅着工件数
FOMC(21日まで)

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
◎ ノーオペ	+34,700	3,101,600	+3,101,600	-0.080	-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)					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	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率
2016/9/20 ~ 2016/10/3	8,000	4,540	4,540	0.00%	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%
2016/9/12 ~ 2016/9/26	8,000	1,970	1,970	0.00%	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%
2016/9/5 ~ 2016/9/20	8,000	1,660	1,660	0.00%	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%
2016/8/29 ~ 2016/9/12	8,000	1,891	1,891	0.00%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%
2016/8/22 ~ 2016/9/5	8,000	1,891	1,891	0.00%	米ドル資金供給オペ				
2016/8/15 ~ 2016/8/29	8,000	1,941	1,941	0.00%	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率
2016/8/9 ~ 2016/11/28	5,000	150	150	0.00%	9/15 ~ 9/23	担保範囲内	2	2	0.900%
2016/8/8 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	9/9 ~ 9/15	担保範囲内	1	1	0.900%

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