

DAILY SIGNAL

平成28年9月20日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは231兆円だった。
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。
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	-	-	2,310,000	+2,310,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/20 のオペ結果
	9/20(火)		9/21(水)		9/23(金)		9/26(月)		
券	▲400		▲800		▲1,000		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(9/23-) (残存5年超10年以下) ▲0.015%按分(49.7%) 4,305億 (残存10年超25年以下) ▲0.03%按分(73.1%) 2,008億 (残存25年超) ▲0.063%按分(50.0%) 1,202億 11:50 国債補完供給(9/20-9/21) ▲0.600%全取 654億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補完供給(9/20-9/21) ▲0.600%全取 734億
財政	+29,200		+2,400		+1,000		▲2,000		
過不足	+28,800		+1,600		+0		▲1,000		
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				+9,000		+7,500			
国庫短期証券買入				+12,500					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲1,700	+4,500					▲2,000		
CP買現先									
CP等買入	▲1,400		▲800						
社債等買入	▲400								
ETF買入		+100		+300				+1,300	
J-REIT買入									
被災地金融機関支援					▲1,000	+800			
貸出									
国債補完供給	+600	▲1,400	+1,400						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+29,100		+24,000		+7,300		▲1,700		
当座預金残高	3,096,000		3,120,000		3,127,300		3,125,600		
準備預金残高	2,788,700		2,788,700		2,788,700		2,788,700		
積み残し先	2,292,800		2,292,800		2,292,800		2,292,800		
超過準備	2,290,500		2,290,500		2,290,500		2,290,500		
非準備先残高	307,300		307,300		307,300		307,300		
準備預金進捗率	98.1%		98.1%		98.1%		98.1%		
平均	16.7%		16.7%		16.7%		16.7%		
乖離率	81.4%		81.4%		81.4%		81.4%		
共通担保オペ当社予想	ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
当座預金増減	+29,100		+24,000		+7,300		+6,300		
当座預金残高	3,096,000		3,120,000		3,127,300		3,125,600		
準備預金残高	2,788,700		2,788,700		2,788,700		2,788,700		
積み残し先	2,292,800		2,292,800		2,292,800		2,292,800		
超過準備	2,290,500		2,290,500		2,290,500		2,290,500		
非準備先残高	307,300		307,300		307,300		307,300		
準備預金進捗率	98.1%		98.1%		98.1%		98.1%		
平均	16.7%		16.7%		16.7%		16.7%		
乖離率	81.4%		81.4%		81.4%		81.4%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,072.900
9/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 39,300
9/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,600

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

9/16 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,075,200

(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
9/20	635(3M)	-0.3066%	-0.3286%
9/15	634(3M)	-0.3363%	-0.3549%
9/14	633(1Y)	-0.3219%	-0.3398%

9/16 のコール市場残高(前日比)

	合計	75,052	-2,827
有担	20,051	+712	
無担	55,001	-3,539	

*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	-	-	-0.037	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.060	-	-	-0.015	0.030	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.089	-0.084	-	-0.095	-0.132	-0.137	-0.138	-	-0.163	-0.225	-0.227

9/21 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.086%～▲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。

9/21 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合及び同結果の公表
黒田日銀総裁会見
貿易統計(8月)

9/21 の予定(海外)

米 FOMC、声明と経済予測(SEP)発表
イェンFRB議長会見
22日(独)ECB総裁の講演

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	+24,000	3,120,000	+3,120,000	-0.086	-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
2016/9/20 ~ 2016/10/3	8,000	4,540	4,540	0.00%	固定金利	札割れ
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

*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%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

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	-
9/9 ~ 9/15	担保範囲内	1	1	0.900%	固定金利	-

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