

DAILY SIGNAL

平成28年9月23日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは234兆円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出合から始まり、
その後は▲0.08%～▲0.04%のレンジで取引された。
後場に入っても地合いは変わらず、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,340,000	+2,340,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/23 のオペ結果
	9/23(金)		9/26(月)		9/27(火)		9/28(水)		
券	▲200		+800		+0		+0		9:20
財政	▲4,100		+2,300		▲5,000		▲11,000		ノーオペ
過不足	▲4,300		+3,100		▲5,000		▲11,000		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	国庫短期証券買入(9/27-)
国債買入	+8,100								▲0.035%按分(87.0%) 7,500億
国庫短期証券買入					+7,500				11:50
国債買現先									国債補完供給(9/23-9/26)
共通担保(本店)			▲2,000		+2,400				▲0.600% 全取 998億
共通担保(全店)									12:50
CP買現先			▲600						ノーオペ
CP等買入	▲800		▲100		+1,300				13:00
社債等買入	▲100		▲100		+100				ノーオペ
ETF買入							+500		13:50
J-REIT買入									国債補完供給(9/23-9/26)
被災地金融機関支援	▲1,000		+800						▲0.600% 全取 433億
貸出	+1,100		▲1,500		+1,500				
国債補完供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+2,800		+5,700		+2,500		▲11,000		
当座預金残高	3,121,800		3,127,500		3,130,000		3,119,000		
準備預金残高	2,814,700		2,812,500		2,810,000		2,808,000		
積み終り先	2,334,300		2,334,300		2,334,300		2,334,300		共通担保(本店) 0
超過準備	2,332,700		2,332,700		2,332,700		2,332,700		共通担保(全店) 6,890
非準備預金残高	307,100		307,100		307,100		307,100		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.5%		99.5%		99.5%		99.5%		CP買現先 0
平均	33.3%		33.3%		33.3%		33.3%		成長基盤強化 71,647
乖離率	66.1%		66.1%		66.1%		66.1%		被災地金融機関支援 4,880
			予想込増減 +5,700		予想込増減 +2,500		予想込増減 ▲11,000		ローンハート残高 0
			当預見込 3,127,500		当預見込 3,130,000		当預見込 3,119,000		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,072.900
9/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 11,100
9/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ口	CP現先	レボG.C
オファー	-0.030	-	-0.100	-0.090
ビッド	-	-	0.000	-0.080
出来値	-	-	-	-

9/21 時点のマナターベース(単位:億円) **4,128.600**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	9/20
長期国債	202	282	337
CP等	2.2	2.2	2.7
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	3.8	6.9	9.3
J-REIT	0.18	0.27	0.33
貸出支援基金	25	31	35
国庫短期証券	49	43	55
その他とも資産計	300	383	452
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	310
その他とも負債・純資産計	300	383	452

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
9/20	635(3M)	-0.3066%	-0.3286%
9/15	634(3M)	-0.3363%	-0.3549%
9/14	633(1Y)	-0.3219%	-0.3398%

9/21 のコール市場残高(前日比)

	合計	72,540	+1,792
有担	19,901	+302	
無担	52,639	+1,490	

*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	-0.075	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-	-	-0.032	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.085	-0.081	-	-0.147	-0.135	-0.135	-0.135	-	-0.168	-0.225	-0.227

9/26 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.08%～+0.01%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。

9/26 の予定(国内)

8:50 6月末の資金循環速報(日銀)
14:00 7月の景気動向指数改訂値(内閣府)
14:35 黒田日銀総裁挨拶(大阪)

9/26 の予定(海外)

欧 ECB総裁が欧州議会で証言
独 IFO景況感指数
米 新築住宅販売件数(8月)

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	+5,700	3,127,500	+3,127,500	-0.080	-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
2016/9/26 ~ 2016/10/11	8,000	2,400	2,400	0.00%	固定金利	札割れ
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

*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
9/23 ~ 9/29	担保範囲内	1	1	0.950%	固定金利	-
9/15 ~ 9/23	担保範囲内	2	2	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