

DAILY SIGNAL

平成28年9月26日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは234兆8,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出合から始まった。
その後は▲0.075%～▲0.035%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、引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,348,000	+2,348,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/26 のオペ結果
	9/26(月)		9/27(火)		9/28(水)		9/29(木)		
券	+900		+0		+0		+0		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(9/28-) (残存1年超3年以下) ▲0.005%按分(76.1%) 4,004億 (残存3年超5年以下) ▲0.007%按分(65.7%) 4,206億 (残存5年超10年以下) ▲0.009%按分(79.3%) 4,310億 (物価連動債) ▲0.200円(31.4%) 251億 11:50 国債補完供給(9/26-9/27) ▲0.600%全取 1,285億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補完供給(9/26-9/27) ▲0.600%全取 304億 共通担保(本店) 0 共通担保(全店) 7,320 国債買現先 0 CP買現先 0 成長基盤強化 71,647 被災地金融機関支援 4,880 ロンハート残高 0
財政	+2,300		▲7,200		▲11,000		▲4,000		
過不足	+3,200		▲7,200		▲11,000		▲4,000		
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									
国庫短期証券買入				+7,500		+12,800			
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲2,000	+2,400							
CP買現先			▲700						
CP等買入	▲600								
社債等買入	▲100	+1,300							
ETF買入		+100		+100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+1,500	▲1,600	+1,600						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+4,200		+1,300		+1,800		▲4,000		
当座預金残高	3,126,000		3,127,300		3,129,100		3,125,100		
準備預金残高	2,819,600		2,819,600		2,819,600		2,819,600		
積み残し先	2,341,500		2,341,500		2,341,500		2,341,500		
超過準備	2,341,500		2,341,500		2,341,500		2,341,500		
非準備先残高	306,400		306,400		306,400		306,400		
準備預金進捗率	99.5%		99.5%		99.5%		99.5%		
平均	36.7%		36.7%		36.7%		36.7%		
乖離率	62.9%		62.9%		62.9%		62.9%		
当座預金増減	+4,200		+1,300		+1,800		▲4,000		
当座預金残高	3,126,000		3,127,300		3,129,100		3,125,100		
準備預金残高	2,819,600		2,819,600		2,819,600		2,819,600		
積み残し先	2,341,500		2,341,500		2,341,500		2,341,500		
超過準備	2,341,500		2,341,500		2,341,500		2,341,500		
非準備先残高	306,400		306,400		306,400		306,400		
準備預金進捗率	99.5%		99.5%		99.5%		99.5%		
平均	36.7%		36.7%		36.7%		36.7%		
乖離率	62.9%		62.9%		62.9%		62.9%		
当座預金増減	+4,200		+1,300		+1,800		▲4,000		
当座預金残高	3,126,000		3,127,300		3,129,100		3,125,100		
準備預金残高	2,819,600		2,819,600		2,819,600		2,819,600		
積み残し先	2,341,500		2,341,500		2,341,500		2,341,500		
超過準備	2,341,500		2,341,500		2,341,500		2,341,500		
非準備先残高	306,400		306,400		306,400		306,400		
準備預金進捗率	99.5%		99.5%		99.5%		99.5%		
平均	36.7%		36.7%		36.7%		36.7%		
乖離率	62.9%		62.9%		62.9%		62.9%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,072.900
9/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 9,700
9/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.030	-0.100
レボG.C	-	-0.090
ビット	-	0.000
レボG.C	-	-0.075
出来値	-	-

9/23 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,131,700

(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%

9/23 のコール市場残高(前日比)

	合計	前日比
有担	73,065	+525
無担	19,957	+56
合計	53,108	+469

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.050	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.050	0.000	-	-	-	-	-0.038	-	-	-	-
東京レポレート	-0.084	-0.082	-	-0.149	-0.136	-0.135	-0.135	-	-0.168	-0.224	-0.226

9/27 オフアのオペと市場動向予想

足許は▲0.08%～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノオベを予想。

9/27 の予定(国内)

8:50 8月の企業向けサービス価格指数(日銀)
7月28日～29日の金融政策決定会合議事録(日銀)

9/27 の予定(海外)

米 9月の消費者信頼感指数

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	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオベ	+1,300	3,127,300	+3,127,300	-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)

期間	オフア額	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	オフア額	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	オフア額	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	- 1.00
9/15 ~ 9/23	担保範囲内	2	2	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