

DAILY SIGNAL

平成28年9月27日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは235兆2,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%の合から始まり、
その後は▲0.065%～▲0.035%のレンジで取引された。
後場に入っても堅調な地合いが続き、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	-	-	2,352,000	+2,352,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/27 のオペ結果
	9/27(火)		9/28(水)		9/29(木)		9/30(金)		
券	+0		+0		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲8,200		▲9,400		▲4,000		+2,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲8,200		▲9,400		▲4,000		+2,000		10:40 米ドル資金供給(9/29-10/6) 貸付利率0.850% 655百万米ドル CP等買入(9/30-) ▲0.067% 按分(80.0%) 5,500億
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	11:50 国債補完供給(9/27-9/28) ▲0.600% 全取 800億
国債買入				+13,000					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入		+7,500							13:00 ノーオペ
国債買現先								+5,500	ノーオペ
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲700		▲600						
社債等買入									
ETF買入		+100		+300					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+1,600	▲800	+800						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲500		+4,100		▲4,000		+7,500		
当座預金残高	3,125,500		3,129,600		3,125,600		3,133,100		
準備預金残高	2,818,300		2,818,300		2,818,300		2,818,300		共通担保(本店) 0
積み終了先	2,344,900		2,344,900		2,344,900		2,344,900		共通担保(全店) 7,320
超過準備	2,344,900		2,344,900		2,344,900		2,344,900		国債買現先 0
非準備先残高	307,200		307,200		307,200		307,200		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		成長基盤強化 71,647
平均	40.0%		40.0%		40.0%		40.0%		被災地金融機関支援 4,880
乖離率	59.6%		59.6%		59.6%		59.6%		ローンハート残高 0
予想込増減	+4,100		+4,100		▲4,000		+7,500		
当預見込	3,129,600		3,129,600		3,125,600		3,133,100		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,072.900
9/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 8,600
9/28 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		
オファー	-0.030	-0.100
ビッド	-	0.000
出来値	-	-

9/26 時点のマナターベース(単位:億円) 4,135,000

(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%

9/26 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	74,490	20,873	53,617
	+1,425	+916	+509

*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	-0.065	-	-	-0.010	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.045	0.000	-	0.003	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.083	-0.080	-	-0.176	-0.141	-0.137	-0.135	-	-0.169	-0.224	-0.226

9/28 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.07%～+0.001%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。

9/28 の予定(国内)

特になし

9/28 の予定(海外)

米 イェンFRB議長が議会証言
週間のMBA住宅ローン申請指数
独 ドラギ ECB総裁が議会証言

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	+4,100	3,129,600	+3,129,600	-0.070	-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
2016/9/26 ~ 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
9/29 ~ 10/6	担保範囲内	655	655	0.850%	固定金利	- 1.00
9/23 ~ 9/29	担保範囲内	1	1	0.950%	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