

DAILY SIGNAL

平成29年9月12日(火)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

9/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは326兆円だった。
無担保コールON物は▲0.06%の出入りから始まった。その後は主に、
▲0.075%～▲0.05%の水準で出入りが見られた。
同加重平均金利は▲0.063%と前日対比0.001%上昇した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,260,000	3,260,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/12 のオペ結果
	9/12(火)		9/13(水)		9/14(木)		9/15(金)		9/12 のオペ結果
券	+600		+300		+0		▲2,000		9:20 ノーオペ
財政	+6,200		▲400		+2,000		▲14,000		10:10 ノーオペ
過不足	+6,800		▲100		+2,000		▲16,000		10:40 ノーオペ
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	10:50 米ドル資金供給(9/14-9/21) 貸付利率 1.660% 2百万米ドル
国債買入		+9,300							11:50 国債補完供給(9/12-9/13) ▲0.600% 全取 346億
国庫短期証券買入		+7,500							12:50 ノーオペ
国債買現先									13:00 ノーオペ
国債売現先									13:50 国債補完供給(9/12-9/13) ▲0.600% 全取 290億
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300	+3,500	▲300						
社債等買入	▲200								
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+400	▲700	+700						
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援								▲4,900	
当座預金増減	+26,300		+300		+2,000		▲20,900		
当座預金残高	3,638,700		3,639,000		3,641,000		3,620,100		
準備預金残高	3,246,000		3,245,800		3,245,800		3,245,800		共通担保(全店) 3,735
積み終了先	3,245,800		3,245,800		3,245,800		3,245,800		国債買現先 0
超過準備	3,245,800		3,245,800		3,245,800		3,245,800		CP買現先 0
非準備先残高	392,700		392,700		392,700		392,700		成長基盤強化 92,686
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		被災地金融機関支援 5,238
平均	90.3%		90.3%		90.3%		90.3%		ロンハート残高 0
乖離率	9.6%		9.6%		9.6%		9.6%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,012,400
9/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200
9/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.050	-	-0.100	-0.090
ビッド	-0.070	-	0.000	-0.080
出来値	-	-	-	-

9/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,663,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	9/10
長期国債	282	361	408
CP等	2.2	2.3	2.2
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	6.9	11.1	15.5
J-REIT	0.27	0.36	0.42
貸出支援基金	31	41	47
国庫短期証券	43	50	30
その他とも資産計	383	476	514
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	362
その他とも負債・純資産計	383	476	514

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
9/7	707 (3M)	-0.1864%	-0.2040%
9/6	706 (6M)	-0.1823%	-0.1983%
8/31	705 (3M)	-0.1683%	-0.1760%

9/11 のコール市場残高(前日比)

合計	98,520	+3,076
有担	23,575	-142
無担	74,945	+3,218

*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	-0.078	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.063	-0.050	-	-0.035	-0.055	-0.025	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.093	-0.087	-	-0.098	-0.098	-0.139	-0.128	-	-0.121	-0.130	-0.152

9/13 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.086～+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。

9/13 の予定(国内)

8:50 8月の企業物価指数(日銀)
7～9月の法人企業景気予測調査
(財務省・内閣府)

9/13 の予定(海外)

米 8月の生産者物価
8月の財政収支
7月のユーロ圏鉱工業生産

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
◎ ノーオペ	+300	3,639,000	+3,639,000	-0.086	-0.060	-0.060	-0.025	-0.025	-0.020	-0.020	-0.010
				～	～	～	～	～	～	～	～
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.080

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2017/9/11 ～ 2017/9/25	8,000	1,985	1,985	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/4 ～ 2017/9/19	8,000	1,360	1,360	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/28 ～ 2017/9/11	8,000	1,932	1,932	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/21 ～ 2017/9/4	8,000	1,451	1,451	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/14 ～ 2017/8/28	8,000	1,530	1,530	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/8/7 ～ 2017/8/21	8,000	1,310	1,310	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/31 ～ 2017/11/6	5,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/7/31 ～ 2017/8/14	8,000	1,480	1,480	0.00%	固定金利	-	札割れ

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2017/5/24 ～ 2017/5/25	1,000	28	28	0.00%	0.000%	-	札割れ
2016/10/20 ～ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ
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%	1.24
米ドル資金供給オペ							
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
9/14 ～ 9/21	担保範囲内	2	2	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
9/8 ～ 9/14	担保範囲内	2	2	1.660%	固定金利	0.0%	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なく、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