

DAILY SIGNAL

平成29年9月19日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/19 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%の出合から始まった。
その後は主に、▲0.075%~▲0.05%の水準で出合が見られた。
積初日であったが、地合に大きな変化は見られず、同加重平均金利は▲0.061%と前日対比▲0.002%であった。

(単位:億円)

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/19 のオペ結果
	9/19(火)		9/20(水)		9/21(木)		9/22(金)		
券	+700		+300		+0		▲1,000		9/20 ノーオペ
財政	▲400		+34,800		+2,000		▲3,000		10:10 国庫短期証券買入(9/21-)
過不足	+300		+35,100		+2,000		▲4,000		+0.000% 按分(91.5%)10,002億
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	国債買入(9/21-)
国債買入				+9,000		+5,400			(残存1年以下)
国庫短期証券買入						+10,000			+0.002% 按分(99.7%)1,002億
国債買現先									(残存5年超10年以下)
国債売現先									+0.008% 按分(89.9%)4,105億
共通担保(本店)									(物価連動債)
共通担保(全店)	▲1,500	+4,400							+0.300円 按分(84.6%)250億
CP買現先									10:40
CP等買入	▲300	+2,500	▲300						米ドル資金供給(9/21-9/28)
社債等買入	▲100		▲800						貸付利率 1.660% 2百万米ドル
ETF買入									社債等買入(9/25-)
J-REIT買入									+0.020% 按分(16.9%)1,251億
被災地金融機関支援									11:50
貸出									国債補完供給(9/19-9/20)
国債補完供給		▲200	+200						▲0.600% 全取 57億
米ドル供給用担保国債供給									12:50
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									13:00
									ノーオペ
									13:50
									国債補完供給(9/19-9/20)
当座預金増減	+5,100		+43,200		+17,400		▲4,000		▲0.600% 全取 166億
当座預金残高	3,657,800		3,701,000		3,718,400		3,714,400		
準備預金残高	3,246,600		3,231,000		3,231,000		3,231,000		
積み終了先	3,231,000		3,231,000		3,231,000		3,231,000		
超過準備	3,225,100		3,225,100		3,225,100		3,225,100		
非準備先残高	411,200		411,200		411,200		411,200		
準備預金進捗率	98.6%		98.6%		98.6%		98.6%		
平均	13.3%		13.3%		13.3%		13.3%		
乖離率	85.3%		85.3%		85.3%		85.3%		
			予想込増減	+43,200	予想込増減	+17,400	予想込増減	▲4,000	
			当預見込	3,701,000	当預見込	3,718,400	当預見込	3,714,400	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,911,500
9/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 40,000
9/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,500

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

9/15 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,704,700

(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	回数	最高利回	平均利回
9/15	709 (1Y)	-0.1278%	-0.1308%
9/14	708 (3M)	-0.1175%	-0.1394%
9/7	707 (3M)	-0.1864%	-0.2040%

9/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	91,202	-10,240
有担	23,542	-4,219	
無担	67,660	-6,021	

*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	-	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.061	-	-	-0.024	0.040	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.085	-0.074	-	-0.087	-0.115	-0.111	-0.109	-	-0.113	-0.129	-0.151

9/20 オファター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。
共通担保オペはノーオペを予想。

9/20 の予定(国内)

金融政策決定会合(21日まで)
8:50 8月の貿易統計(財務省)
4-6月の資金循環速報(日銀)

9/20 の予定(海外)

米 FOMC(2日目)
イエレン議長の会見
8月の中古住宅販売件数

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
◎ ノーオペ	+43,200	3,701,000	+3,701,000	-0.080	-0.055	-0.020	-0.020	-0.020	-0.020	-0.020	-0.010	-0.010
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.030	0.040	0.050	0.080	0.100

共通担保資金供給(全店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2017/9/19 ~ 2017/10/2	8,000	4,300	4,300	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/9/19 ~ 2017/12/25	5,000	120	120	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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

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