

DAILY SIGNAL

平成29年9月22日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは330兆1,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.04%の出合から始まった。週末3日積みということもあり、昨日よりも地合は強含み、▲0.07~▲0.03%のレンジで取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、後場にかけて▲0.07%台後半の出合も見られた。
同加重平均金利は▲0.046%と前日対比+0.008%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,301,000	3,301,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/22 のオペ結果
	9/22(金)		9/25(月)		9/26(火)		9/27(水)		
券	▲800		+100		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲7,200		+5,300		▲3,000		▲10,000		10:10 国庫短期証券買入(9/26-)
過不足	▲8,000		+5,400		▲3,000		▲10,000		0.000% 按分(73.6%)10,003億
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(9/22-9/25)
国債買入									▲0.600% 全取 1,462億
国庫短期証券買入						+10,000			
国債買現先									12:50 ノーオペ
国債売現先									13:00 ノーオペ
共通担保(本店)			▲2,000	+2,400					13:50 国債補完供給(9/22-9/25)
共通担保(全店)									▲0.600% 全取 139億
CP買現先									
CP等買入	▲900		▲600						
社債等買入			▲300	+1,300					
ETF買入		+400		+400					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援	▲800	+800							
貸出									
国債補完供給	+500	▲1,700	+1,700						
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									
当座預金増減	▲9,700		+8,300		+7,000		▲10,000		
当座預金残高	3,706,600		3,714,900		3,721,900		3,711,900		
準備預金残高	3,288,600		3,286,700		3,286,700		3,286,700		
積み終了先	3,286,700		3,286,700		3,286,700		3,286,700		
超過準備	3,286,300		3,286,300		3,286,300		3,286,300		
非準備先残高	418,000		418,000		418,000		418,000		
準備預金進捗率	99.4%		99.4%		99.4%		99.4%		
平均	30.0%		30.0%		30.0%		30.0%		
乖離率	69.4%		69.4%		69.4%		69.4%		
共通担保オペ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 6,625
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 92,686
									被災地金融機関支援 5,235
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,911,500
9/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 16,900
9/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 800

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.035	-	-0.100	-0.070
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.055
出来値	-	-	-	-

9/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,768,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	9/20
長期国債	282	361	402
CP等	2.2	2.3	2.5
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	6.9	11.1	15.7
J-REIT	0.27	0.36	0.43
貸出支援基金	31	41	48
国庫短期証券	43	50	30
その他とも資産計	383	476	510
銀行券	98	102	100
当座預金	253	330	370
その他とも負債・純資産計	383	476	510

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	710 (3M)	-0.1002%	-0.1074%
9/15	709 (1Y)	-0.1278%	-0.1308%
9/14	708 (3M)	-0.1175%	-0.1394%

9/21 のコール市場残高(前日比)

	合計	100,448	+3,355
有担	22,502	-201	
無担	77,946	+3,556	

*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	-	-	-0.050	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.046	-	-	-0.048	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.072	-0.063	-	-0.140	-0.116	-0.111	-0.110	-	-0.112	-0.129	-0.151

9/25 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。

9/25 の予定(国内)

国債投資家懇談会(財務省)
黒田日銀総裁、大阪経済4団体と

9/25 の予定(海外)

米 NY連銀総裁の講演、シカゴ連銀総裁の講演
メアホリス連銀総裁の講演
ECB総裁の講演(ブリュッセル)

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	+8,300	3,714,900	+3,714,900	-0.080	-0.020	-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	*当日物		
					平均レド	按分率	倍率
2017/9/25 ~ 2017/10/10	8,000	2,386	2,386	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

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	*当日物		
					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
米ドル資金供給オペ							
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
9/21 ~ 9/28	担保範囲内	2	2	1.660%	固定金利	0.0%	1.00
9/14 ~ 9/21	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