

DAILY SIGNAL

平成28年9月29日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは234兆7,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%の出しからスタートした。
その後は▲0.05%～▲0.03%のレンジで取引された。
後場に入っても堅調な地合いは続き、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	-	-	2,347,000	+2,347,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/29 のオペ結果
	9/29(木)		9/30(金)		10/3(月)		10/4(火)		
券	▲800		▲400		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲6,700		▲8,800		▲27,000		▲31,000		ノーオペ
過不足	▲7,500		▲9,200		▲26,000		▲30,000		10:10
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	ノーオペ
国債買入				+12,000					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(9/29-9/30)
国債買現先									▲0.500% 全取 195億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲4,500	+1,900			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲700		▲7,800	+5,500					共通担保(全店)×(固定金利)
社債等買入									(10/3-10/17)
ETF買入		+1,100		+1,900					0% 全取 1,910億
J-REIT買入									13:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(9/29-9/30)
貸出									▲0.500% 全取 4億
国債補完供給	+600	▲200	+200						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲6,700		+2,600		▲28,600		▲30,000		
当座預金残高	3,122,800		3,125,400		3,096,800		3,066,800		
準備預金残高	2,815,100		2,347,000		ノープ		ノープ		共通担保(本店)
積み残し先	2,347,000		ノープ		ノープ		ノープ		共通担保(全店)
超過準備	2,347,000		ノープ		ノープ		ノープ		国債買現先
非準備先残高	307,700		ノープ		ノープ		ノープ		CP買現先
準備預金進捗率	99.7%		ノープ		ノープ		ノープ		成長基盤強化
平均	46.7%		ノープ		ノープ		ノープ		被災地金融機関支援
乖離率	53.0%		ノープ		ノープ		ノープ		ローンハート残高
			予想込増減	+2,600	予想込増減	▲28,600	予想込増減	▲30,000	0
			当預見込	3,125,400	当預見込	3,096,800	当預見込	3,066,800	7,320

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,073.200
9/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,900
9/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	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	-	-	0.000	-0.075
出来値	-	-	-	-

9/28 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,138,500

(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
準備預金	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
9/29	636(3M)	-0.3407%	-0.3547%
9/20	635(3M)	-0.3066%	-0.3286%
9/15	634(3M)	-0.3363%	-0.3549%

9/28 のコール市場残高(前日比)

	合計	76,788	-1,481
有担	20,252	-516	
無担	56,536	-965	

*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	-0.080	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.037	-0.010	-	0.004	0.010	0.030	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.336	-	-0.092	-0.097	-0.104	-0.121	-	-0.170	-0.229	-0.233

9/30 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。

9/30 の予定(国内)

8:30 CPI(8月全国・9月東京都区部、総務省)
8:50 9月の金融政策決定会合における主な意見(日銀)
14:00 8月の基調的なインフレ率を補正するための指標速報(日銀)

9/30 の予定(海外)

米 8月個人消費支出
9月シカン大消費者信頼感確報
欧 9月のCPI速報

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
◎ ノープ	+2,600	3,125,400	+3,125,400	-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	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/10/3 ~ 2016/10/17	8,000	1,910	1,910	0.00%	固定金利	-	札割れ
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

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	按分率	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%	1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46

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	按分率	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