

DAILY SIGNAL

平成27年9月7日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは177兆3,000億円。
無担保コールON物は朝方0.076%の出会いから始まり、その後も0.075~0.077%で推移した。後場に入り、一部調整程度の出合いが散見され引けた。
本日公表された8月の無担保コール市場平均残高は7兆5,546億円で7月平均残高から8,194億円増加した。

	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,773,000	+1,773,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/7 のオペ結果
	9/7(月)		9/8(火)		9/9(水)		9/10(木)		
券	+1,600		+1,000		+0		▲1,000		9:20 ノオペ 10:10 国債買入(9/9-) (残存1年超3年以下) +0.007%按分(46.8%) 4,002億 (残存3年超5年以下) +0.003%按分(64.6%) 4,006億 (残存5年超10年以下) +0.003%按分(54.8%) 4,002億 11:50 国債補完供給(9/7-9/8) ▲0.400% 10億 12:50 ノオペ 13:00 ノオペ
財政	▲7,800		+1,400		▲1,000		▲21,000		
過不足	▲6,200		+2,400		▲1,000		▲22,000		
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			+4,900		+12,000				
国庫短期証券買入			+6,000						
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲700	+600	▲7,200	+9,200					
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲500						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+300								
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲6,200		+20,200		+11,000		▲22,000		
当座預金残高	2,326,200		2,346,400		2,357,400		2,335,400		
準備預金残高	2,119,200								
積み終了先	1,775,300								
超過準備	1,775,300								
非準備預金残高	207,000								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	74.2%		予想込増減 +20,200		予想込増減 +11,000		予想込増減 ▲22,000		
乖離率	25.7%		当預見込 2,346,400		当預見込 2,357,400		当預見込 2,335,400		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,028,900
9/8以降の残り積み立て額(残り所要)積数 2,100
9/8以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.050	0.060	0.065
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

9/4 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,290,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	8/31
長期国債	142	202	258
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	6.0
J-REIT	0.14	0.18	0.25
貸出支援基金	9.2	25	29
国庫短期証券	40	49	49
その他とも資産計	224	300	361
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	231
その他とも負債・純資産計	224	300	361

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
9/3	555(3M)	0.0000%	-0.0032%
8/27	554(3M)	-0.0020%	-0.0056%
8/20	553(3M)	-0.0059%	-0.0087%

9/4 のコール市場残高(前日比)			
合計	199,654	-4,944	
有担	129,849	-1,843	
無担	69,805	-3,101	

*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	0.060	0.072	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.130	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.085	0.125	0.117	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.055	0.081	-	0.055	0.049	0.044	0.021	-	0.035	0.041	0.049

9/8 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は引き続き0.07%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペはノオペを予想する。

9/8 の予定(国内)

8:50 4~6月の実質GDP・2次速報(内閣府)
7月の国際収支(財務省)
8月の対外対内証券売買(財務省)

9/8 の予定(海外)

米 FRBの8月の労働市場情勢指数
ユーロ圏 4~6月のGDP確報

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想								
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
◎ ノオペ	+20,200	2,346,400	+2,346,400	0.055	0.075	0.075	0.080	0.085	0.117	0.118	0.130	0.200
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.140	0.155	0.160	0.170	0.300

共通担保資金供給(全店)					*当日物					共通担保資金供給(本店)					*当日物				
期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24				
2015/9/7 ~ 2015/12/7	8,000	580	580	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70				
2015/9/4 ~ 2015/12/11	15,000	8,210	8,210	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46				
2015/9/1 ~ 2015/12/11	15,000	8,450	8,450	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70				
2015/8/31 ~ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/8/28 ~ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2015/8/24 ~ 2015/11/24	8,000	2,691	2,691	0.10%	固定金利	-	札割れ	9/3 ~ 9/11	担保範囲内	0	0	0.640%	固定金利	-	応札なし				
2015/8/17 ~ 2015/11/16	8,000	1,240	1,240	0.10%	固定金利	-	札割れ	8/27 ~ 9/3	担保範囲内	2	2	0.640%	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