

DAILY SIGNAL

平成28年8月31日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

8/31 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは227兆1,000億円だった。
月末となる本日の無担保コールON物は、昨日よりビッドが薄く、▲0.04%の出合から始まり、
その後は▲0.07%～▲0.02%のレンジで取引された。
加重平均金利は昨日対比0.002%低下し、▲0.048%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	-	-	2,271,000	+2,271,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				8/31 のオペ結果
	8/31(水)		9/1(木)		9/2(金)		9/5(月)		
券	+200		+0		+0		+1,000		9:20
財政	+900		▲10,200		▲15,000		▲1,000		ノオベ
過不足	+1,100		▲10,200		▲15,000		+0		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	ノオベ
国債買入		+11,700							11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(8/31-9/1)
国債買現先									▲0.500%全取 1,954億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)									ノオベ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲2,900	+3,500	▲300						ノオベ
社債等買入	▲100			+100					13:50
ETF買入									国債補完供給(8/31-9/1)
J-REIT買入									▲0.500%全取 9億
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+400	▲2,000	+2,000						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+11,700		▲8,400		▲11,500		▲1,900		
当座預金残高	3,035,000		3,026,600		3,015,100		3,013,200		
準備預金残高	2,731,100		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(本店) 0
積み終了先	2,268,200		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		4,162
超過準備	2,267,900		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		0
非準備先残高	303,900		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		0
準備預金進捗率	99.7%		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		0
平均	51.6%		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		0
乖離率	48.1%		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		0
予想込増減	▲8,400		▲8,400		▲11,500		▲11,500		成長基盤強化 68,139
当預見込	3,026,600		3,026,600		3,015,100		3,021,200		被災地金融機関支援 5,045
当預見込	3,026,600		3,026,600		3,015,100		3,021,200		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,141,700
9/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 5,700
9/1 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	-0.015	-0.100
レボG.C	-0.095	-0.085
ビッド	-0.040	0.000
レボG.C	-0.085	-0.085
出来値	-	-

8/30 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,033,800**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	8/20
長期国債	202	282	335
CP等	2.2	2.2	2.5
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	3.8	6.9	8.9
J-REIT	0.18	0.27	0.33
貸出支援基金	25	31	33
国庫短期証券	49	43	56
その他とも資産計	300	383	448
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	305
その他とも負債・純資産計	300	383	448

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
8/25	629(3M)	-0.2104%	-0.2280%
8/18	628(3M)	-0.2124%	-0.2341%
8/17	627(1Y)	-0.2410%	-0.2480%

8/30 のコール市場残高(前日比)

	合計	前日比
有担	77,313	+4,667
無担	18,824	-187
合計	58,489	+4,854

*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	-0.050	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	-0.028	-	-	-0.021	-	-0.030	-	-	-	-
東京レボレート	-0.086	-0.088	-	-0.088	-0.089	-0.094	-0.104	-	-0.136	-0.224	-0.225

9/1 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.06～▲0.02%のレンジで取引されよう。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想。

9/1 の予定(国内)

16:00 8月調査の債券市場サーベイ(日銀)

9/1 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
8月ISM製造業指数
クレーブランド連銀総裁の講演

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
◎	ノオベ	▲8,400	3,026,600	+3,026,600	-0.080	-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	倍率
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
2016/8/9 ~ 2016/11/28	5,000	150	150	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/8 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/8/1 ~ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/25 ~ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/7/19 ~ 2016/8/1	8,000	4,040	4,040	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	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%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

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	倍率
9/1 ~ 9/9	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	- 応札なし
8/25 ~ 9/1	担保範囲内	11	11	0.900%	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(登名)第 243号 加入協会 日本証券業協会