

DAILY SIGNAL

平成28年9月2日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは225兆7,000億円だった。
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、▲0.07%～▲0.025%のレンジで取引された。一巡後も同水準での取引が見られ、後場に入るとそのまま引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,257,000	+2,257,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/2 のオペ結果
	9/2(金)		9/5(月)		9/6(火)		9/7(水)		
券	+0		+1,400		+1,000		+0		9:20
財政	▲14,800		▲9,500		+1,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲14,800		▲8,100		+2,000		+1,000		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	国庫短期証券買入(9/6-)
国債買入									▲0.018%按分(50.3%) 7,501億
国庫短期証券買入									国債買入(9/6-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲1,900	+1,700					▲0.006%按分(26.0%) 4,002億
共通担保(全店)									(残存3年超5年以下)
CP買現先									+0.011%按分(65.1%) 4,206億
CP等買入	▲200		▲300						(残存5年超10年以下)
社債等買入			▲100						+0.017%按分(44.3%) 4,303億
ETF買入		+100							11:50
J-REIT買入									国債補完供給(9/2-9/5)
被災地金融機関支援									▲0.500%全取 143億
貸出									12:50
国債補完供給	+200	▲200	+200						ノーオペ
成長基盤強化支援	▲3,600	+4,700	▲100						13:00
貸出増加支援									ノーオペ
									13:50
									国債補完供給(9/2-9/5)
									▲0.500%全取 10億
当座預金増減	▲13,800		▲8,600		+22,000		+1,000		
当座預金残高	3,012,200		3,003,600		3,025,600		3,026,600		
準備預金残高	2,713,500		2,253,800		ノ-オペ		ノ-オペ		共通担保(本店)
積み終了先	2,253,800		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		共通担保(全店)
超過準備	2,253,700		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		国債買現先
非準備先残高	298,700		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		CP買現先
準備預金進捗率	99.8%		ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		成長基盤強化
平均	64.5%		予想込増減	▲8,600	予想込増減	+22,000	予想込増減	+1,000	被災地金融機関支援
乖離率	35.3%		当預見込	3,003,600	当預見込	3,025,600	当預見込	3,026,600	ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,141,700
9/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,700
9/5 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	-0.015	-0.100
レボ	-0.095	
ビッド	-0.040	0.000
レボ	-0.085	
出来値	-	-

9/1 時点のマナタリーベース(単位:億円) 4,036,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	8/31
長期国債	202	282	340
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	9.1
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	57
その他とも資産計	300	383	453
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	303
その他とも負債・純資産計	300	383	453

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
9/1	630(3M)	-0.2304%	-0.2425%
8/25	629(3M)	-0.2104%	-0.2280%
8/18	628(3M)	-0.2124%	-0.2341%

9/1 のコール市場残高(前日比)		
合計	78,603	+3,556
有担	18,958	-339
無担	59,645	+3,895

*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	-0.055	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.047	-0.051	-	-0.023	-0.040	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.087	-	-0.089	-0.090	-0.095	-0.105	-	-0.136	-0.224	-0.225

9/5 オフアのオペと市場動向予想

足許は▲0.08～▲0.02%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。

9/5 の予定(国内)

黒田日銀総裁が「きさらぎ会」で講演
9:00 7月の毎月勤労統計速報(厚労省)

9/5 の予定(海外)

米 休日(レバ-デー)

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	▲8,600	3,003,600	+3,003,600	-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)					*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				
2016/9/5 ~ 2016/9/20	8,000	1,660	1,660	0.00%	固定金利	-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ				
2016/8/29 ~ 2016/9/12	8,000	1,891	1,891	0.00%	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				
2016/8/22 ~ 2016/9/5	8,000	1,891	1,891	0.00%	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				
2016/8/15 ~ 2016/8/29	8,000	1,941	1,941	0.00%	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				
2016/8/9 ~ 2016/11/28	5,000	150	150	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/8/22 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	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				
2016/8/8 ~ 2016/8/15	8,000	5,100	5,100	0.00%	固定金利	-	札割れ	9/1 ~ 9/9	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	-	応札なし				
2016/7/25 ~ 2016/8/8	8,000	4,790	4,790	0.00%	固定金利	-	札割れ	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