

# DAILY SIGNAL

平成28年9月5日(月)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## 9/5 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは224兆3,000億円だった。  
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%の合出から始まり、その後は▲0.065%～▲0.02%のレンジで取引された。調達一巡後はややビッドが薄くなり、▲0.065%近辺での合出が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,243,000	+2,243,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/5 のオペ結果
	9/5(月)		9/6(火)		9/7(水)		9/8(木)		
券	+1,400		+1,000		+0		+0		9:20
財政	▲9,200		+3,400		+1,000		+0		ノーオペ
過不足	▲7,800		+4,400		+1,000		+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	ノーオペ
国債買入				+12,700					11:50
国庫短期証券買入				+7,500					国債補完供給(9/5-9/6)
国債買現先									▲0.500% 全取 219億
共通担保(本店)	▲1,900	+1,700							12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先			▲200						13:00
CP等買入	▲300								ノーオペ
社債等買入	▲100								13:50
ETF買入				+200					国債補完供給(9/5-9/6)
J-REIT買入									▲0.500% 全取 53億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+200	▲300	+300						
成長基盤強化支援貸出増加支援	▲100								
当座預金増減	▲8,600		+24,900		+1,000		+0		
当座預金残高	3,003,600		3,028,500		3,029,500		3,029,500		
準備預金残高	2,712,700		2,254,400		2,254,400		2,254,400		共通担保(本店)
積み終了先	2,254,400		2,254,400		2,254,400		2,254,400		共通担保(全店)
超過準備	2,254,400		2,254,400		2,254,400		2,254,400		国債買現先
非準備預金残高	290,900		290,900		290,900		290,900		CP買現先
準備預金進捗率	99.8%		99.8%		99.8%		99.8%		成長基盤強化
平均	67.7%		67.7%		67.7%		67.7%		被災地金融機関支援
乖離率	32.1%		32.1%		32.1%		32.1%		ロンバート残高
			予想込増減	+24,900	予想込増減	+1,000	予想込増減	+0	
			当預見込	3,028,500	当預見込	3,029,500	当預見込	3,029,500	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,141,700  
9/6以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,400  
9/6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	-0.100	-0.100
レボG.C	-	-
オファー	-0.015	-
ビッド	-0.040	-
出来値	-	-

9/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,022,600

(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%

## 9/2 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	79,707	+1,104	
	19,247	+289	
	60,460	+815	

\*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	-0.025	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	-0.001	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.045	-0.042	-	-0.013	-0.008	-	0.004	-	-	-	-
東京レボレート	-0.085	-0.088	-	-0.089	-0.090	-0.095	-0.106	-	-0.138	-0.224	-0.225

## 9/6 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.065%～▲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。

## 9/6 の予定(国内)

なし

## 9/6 の予定(海外)

米 8月のISM非製造業指数  
FRBの8月の労働市場情勢指数  
欧 4-6月のGDP確報

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
◎	ノーオペ	+24,900	3,028,500	+3,028,500	-0.065	-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	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	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
2016/9/5 ~ 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							
2016/8/8 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	固定金利	-	札割れ	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
2016/8/1 ~ 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