

DAILY SIGNAL

平成28年9月6日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは226兆6,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%の合算から始まり、その後は▲0.06%～▲0.02%のレンジで取引された。調達一巡後も水準で推移し、後場に入って▲0.065%近辺での合算が見えられた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,266,000	+2,266,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/6 のオペ結果
	9/6(火)		9/7(水)		9/8(木)		9/9(金)		
券	+1,000		+600		+0		▲1,000		9:20
財政	+3,800		+700		+0		+2,000		ノオベ
過不足	+4,800		+1,300		+0		+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	ノオベ
国債買入		+12,700							10:40
国庫短期証券買入		+7,500							CP等買入(9/9-)
国債買現先									▲0.002% 按分(36.4%) 4,990億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(9/6-9/7)
CP買現先									▲0.500% 全取 356億
CP等買入	▲200		▲200				+5,000		12:50
社債等買入									ノオベ
ETF買入		+200		+400					13:00
J-REIT買入									ノオベ
被災地金融機関支援									13:50
貸出									国債補完供給(9/6-9/7)
国債補完供給	+300	▲400	+400						▲0.500% 全取 27億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+24,900		+1,900		+0		+6,000		
当座預金残高	3,028,500		3,030,400		3,030,400		3,036,400		
準備預金残高	2,725,200		2,268,500		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店)
積み終了先	2,268,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)
超過準備	2,268,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先
非準備先残高	303,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先
準備預金進捗率	99.9%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化
平均	71.0%		予想込増減 +1,900		予想込増減 +0		予想込増減 +6,000		被災地金融機関支援
乖離率	28.9%		当預見込 3,030,400		当預見込 3,030,400		当預見込 3,036,400		ローンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,141,700
9/7以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,100
9/7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		
オファー	-0.015	-
レボ	-0.100	-0.100
ビッド	-0.040	-
出来値	-	-

9/5 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,012,600

(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	回数	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%

9/5 のコール市場残高(前日比)			
合計	79,434	-	-273
有担	19,808	-	+561
無担	59,626	-	-834

*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	-0.068	-	-	-0.001	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.002	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.046	-0.055	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.087	-0.094	-	-0.090	-0.091	-0.096	-0.110	-	-0.141	-0.224	-0.225

9/7 オファ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。
共通担保オペはノオベを予想。

9/7 の予定(国内)

14:00 7月の景気動向指数速報(内閣府)
7月の消費活動指数(日銀)

9/7 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
ページブック

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	+1,900	3,030,400	+3,030,400	-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