

DAILY SIGNAL

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

9/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは227兆9,000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.035%の合出から始まった。その後は、▲0.06%～▲0.025%のレンジで取引され、後場に入って調整程度の合出が見込まれて引けた。
本日、日銀は当座預金のマクロ加算残高にかかる基準比率(2016年9月～11月積み期間に適用)を10.0%に定めた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,279,000	+2,279,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/9 のオペ結果
	9/9(金)		9/12(月)		9/13(火)		9/14(水)		
券	+300		+1,200		+1,000		+0		9:20
財政	+0		▲23,200		+0		▲2,000		ノーオペ
過不足	+300		▲22,000		+1,000		▲2,000		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(9/13-)
国債買入		+8,000				+8,900			▲0.006%按分(36.5%) 12,502億
国庫短期証券買入						+12,500			国債買入(9/13-)
国債買現先									(残存1年以下)
共通担保(本店)			▲1,900	+2,000					▲0.015%按分(13.7%) 700億
共通担保(全店)									(残存1年超3年以下)
CP買現先									▲0.018%按分(92.1%) 4,000億
CP等買入	▲500	+5,000	▲200						(残存3年超5年以下)
社債等買入	▲200		▲100						+0.002%按分(51.6%) 4,206億
ETF買入		+700							11:50
J-REIT買入									国債補完供給(9/9-9/12)
被災地金融機関支援貸出									▲0.500% 全取 150億
国債補完供給	+300	▲200	+200						12:50
成長基盤強化支援貸出増加支援									ノーオペ
									13:00
									ノーオペ
									13:50
									国債補完供給(9/9-9/12)
									▲0.500% 全取 3億
当座預金増減	+13,400		▲22,000		+22,400		▲2,000		
当座預金残高	3,043,700		3,021,700		3,044,100		3,042,100		
準備預金残高	2,735,300		2,280,400		2,280,400		2,280,400		
積み終了先	2,280,400		2,280,400		2,280,400		2,280,400		
超過準備	2,280,400		2,280,400		2,280,400		2,280,400		
非準備先残高	308,400		308,400		308,400		308,400		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	87.1%		87.1%		87.1%		87.1%		
乖離率	12.8%		12.8%		12.8%		12.8%		
共通担保オペ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
									共通担保(全店) 3,931
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 71,647
									被災地金融機関支援 5,045
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,149,000
9/12 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 800
9/12 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 200

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
オフア	-0.015	-0.100
レボ	-0.040	-0.095
ビッド	-	-
出来値	-	-

9/8 時点のマナタリーベース(単位:億円) **4,037,400**

(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
9/8	632(3M)	-0.2645%	-0.2817%
9/7	631(6M)	-0.2566%	-0.2769%
9/1	630(3M)	-0.2304%	-0.2425%

9/8 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	83,162	18,413	64,749
	+325	-649	+974

*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	-0.074	-0.060	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.030	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.046	-0.048	-	-0.008	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.094	-0.091	-	-0.097	-0.099	-0.130	-0.136	-	-0.147	-0.224	-0.225

9/12 オフアのオペと市場動向予想

足許は▲0.07%～▲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。

9/12 の予定(国内)

8:50 7月の機械受注(内閣府)
8月の企業物価指数(日銀)

9/12 の予定(海外)

米 プレーナードFRB理事の講演

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	
◎	ノーオペ	▲22,000	3,021,700	+3,021,700	-0.070	-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				
2016/9/12 ~ 2016/9/26	8,000	1,970	1,970	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				
2016/9/5 ~ 2016/9/20	8,000	1,660	1,660	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				
2016/8/29 ~ 2016/9/12	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				
2016/8/22 ~ 2016/9/5	8,000	1,891	1,891	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				
2016/8/15 ~ 2016/8/29	8,000	1,941	1,941	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/8/9 ~ 2016/11/28	5,000	150	150	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 ~ 2016/8/22	8,000	2,040	2,040	0.00%	固定金利	-	札割れ	9/9 ~ 9/15	担保範囲内	1	1	0.900%	固定金利	-	1.00				
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	-	応れなし				

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