

DAILY SIGNAL

平成27年10月1日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは182兆円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%の出会いから始まり、
その後は0.07%台後半で取引された。調達一巡後はビットレートが低下し、
0.07%台半ばでの取引が中心となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,820,000	+1,820,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/1 のオペ結果
	10/1(木)		10/2(金)		10/5(月)		10/6(火)		
券	▲500		▲400		+1,000		+1,000		9:20
財政	+1,400		▲30,500		▲31,000		+1,000		ノーオペ
過不足	+900		▲30,900		▲30,000		+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	ノーオペ
国債買入				+12,000					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(10/1-10/2)
国債買現先									▲0.400% 8億
共通担保(本店)					▲1,800	+1,500			12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲100		▲100						共通担保(全店)(固定金利方式)
社債等買入				+200					(10/5-1/4)
ETF買入									0.10%(札割れ) 1,500億
J-REIT買入									13:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(10/1-10/2)
貸出									▲0.400% 34億
国債補完供給	+400								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+1,200		▲18,800		▲30,300		+2,000		
当座預金残高	2,423,600		2,404,800		2,374,500		2,376,500		
準備預金残高	2,202,100		2,202,100		2,202,100		2,202,100		
積み終了先	1,820,300		1,820,300		1,820,300		1,820,300		共通担保(本店) 0
超過準備	1,819,800		1,819,800		1,819,800		1,819,800		共通担保(全店) 62,701
非準備先残高	221,500		221,500		221,500		221,500		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.8%		99.8%		99.8%		99.8%		CP買現先 0
平均	53.3%		53.3%		53.3%		53.3%		成長基盤強化 51,360
乖離率	46.5%		46.5%		46.5%		46.5%		被災地金融機関支援 3,166
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,952,600
10/2以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,200
10/2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	0.125	-	0.060	0.070
ビット	0.075	-	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

9/30時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,384,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	9/20
長期国債	142	202	263
CP等	2.2	2.2	2.7
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	6.2
J-REIT	0.14	0.18	0.25
貸出支援基金	9.2	25	30
国庫短期証券	40	49	49
その他とも資産計	224	300	368
銀行券	90	93	92
当座預金	107	178	236
その他とも負債・純資産計	224	300	368

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
10/1	561(3M)	-0.0110%	-0.0188%
9/24	560(3M)	-0.0160%	-0.0348%
9/17	559(2M)	-0.0103%	-0.0215%

9/30のコール市場残高(前日比)		
合計	204,167	-13,446
有担	148,248	+9,850
無担	55,919	-23,296

*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	0.050	0.050	-	0.070	-	-	0.116	-	-	-	-
最高	0.130	0.121	-	0.155	-	-	0.245	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	-	0.117	0.160	-	0.167	-	0.630	-	-
東京レボレート	0.030	0.070	-	0.051	0.048	0.044	0.040	-	0.025	0.037	0.047

§ 10/2 オファターのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台半ばでの取引となろう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

10/2 の予定(国内)

8:30 8月の有効求人倍率(厚労省)
8月の完全失業率(総務省)
8:50 9月調査の短観全容・企業の物価見通し(日銀)

10/2 の予定(海外)

米 9月の雇用統計
8月の製造業受注指数
FRB副議長の講演

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想									
即日オペ金額	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	▲18,800	2,404,800	+2,404,800	0.050	0.075	0.075	0.080	0.100	0.118	0.119	0.120	0.200
				~	~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.140	0.155	0.160	0.170	0.300	

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	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	0.10%	固定金利	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%
2015/9/24 ~ 2015/12/21	8,000	1,300	1,300	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%
2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%
2015/9/7 ~ 2015/12/7	8,000	580	580	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%
2015/9/4 ~ 2015/12/15	15,000	8,210	8,210	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%
2015/9/1 ~ 2015/12/11	15,000	8,450	8,450	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%
2015/8/31 ~ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%

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