

DAILY SIGNAL

平成27年9月30日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは182兆7000億円だった。
期末初物となる無担保コールON物は朝方0.001%の出会いから始まった。
その後も終日0.001%のビッドに対するギブンが続いた。
TNは0.07%台半ばの取引が見られた。

日	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,827,000	+1,827,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/30 のオペ結果
	9/30(水)		10/1(木)		10/2(金)		10/5(月)		
券	+300		▲300		+0		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(10/2-) (残存1年超3年以下) +0.007%按分(80.6%) 4,002億 (残存3年超5年以下) +0.004%按分(59.8%) 4,001億 (残存10年超25年以下) +0.010%按分(54.9%) 2,411億 (残存25年超) +0.011%按分(35.0%) 1,408億 11:50 国債補完供給(9/30-10/1) ▲0.400% 367億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補完供給(9/30-10/1) ▲0.400% 26億
財政	▲7,900		+1,300		▲35,000		▲31,000		
過不足	▲7,600		+1,000		▲35,000		▲30,000		
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	
国債買入		+12,100				+11,800			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,800		
CP買現先									
CP等買入	▲7,100	+5,500	▲100						
社債等買入									
ETF買入		+300							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+100	▲400	+400						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+2,900		+1,300		▲23,200		▲31,800		
当座預金残高	2,422,400		2,423,700		2,400,500		2,368,700		
準備預金残高	2,206,700								
積み終了先	1,821,600		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 8,000		
超過準備	1,821,500								
非準備預金残高	215,700								
準備預金進捗率	99.7%								
平均	50.0%		予想込増減 +1,300		予想込増減 ▲23,200		予想込増減 ▲23,800		
乖離率	49.7%		当預見込 2,423,700		当預見込 2,400,500		当預見込 2,376,700		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							62,701		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							51,360		
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
10/1 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 5,600
10/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.125	-	0.060	0.065
ビッド	0.075	-	0.100	0.075
出来値	-	-	-	-

9/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,381,900

(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
9/24	560(3M)	-0.0160%	-0.0348%
9/17	559(2M)	-0.0103%	-0.0215%
9/16	558(1Y)	-0.0161%	-0.0252%

9/29 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	217,613	+6,690	+1,530
	138,398	-	+5,160
	79,215	-	-

*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	0.001	0.070	-	0.075	0.116	0.077	-	-	-	-	-
最高	0.075	0.125	-	0.122	0.310	0.110	-	-	-	-	-
加重平均	0.010	0.080	-	0.109	0.142	0.094	0.070	-	-	-	-
東京レボレート	0.000	0.049	-	0.043	0.041	0.038	0.036	-	0.028	0.037	0.047

10/1 オフアのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台での取引と見られる。
共通担保オペはロールオフアを予想する。

10/1 の予定(国内)

8:50 9月調査の短観・概要(日銀)
対外対内証券売買契約等の状況(財務省)

10/1 の予定(海外)

米 新規失業保険申請件数
8月の建設支出
9月のISM製造業指数

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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオベ	+1,300	2,423,700	+2,423,700	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	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
2015/9/24 ~ 2015/12/21	8,000	1,300	1,300	0.10%	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	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	0.10%	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ					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			
2015/9/7 ~ 2015/12/7	8,000	580	580	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/1 ~ 10/8	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし								
2015/9/4 ~ 2015/12/15	15,000	8,210	8,210	0.10%	固定金利	-	札割れ	9/17 ~ 10/1	担保範囲内	539	539	0.690%	固定金利	-	1.00								
2015/9/1 ~ 2015/12/11	15,000	8,450	8,450	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/8/31 ~ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/8/28 ~ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	0.10%	固定金利	-	札割れ																

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