

# DAILY SIGNAL

平成27年10月2日(金)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 10/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは180兆7000億円だった。  
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0.077~0.078%で取引される堅調な地合いとなった。  
後場に入るとビットレートは低下し0.075%近辺で取引された。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,807,000	+1,807,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/2 のオペ結果
	10/2(金)		10/5(月)		10/6(火)		10/7(水)		
券	▲300		+1,300		+1,000		+0		9:20
財政	▲29,700		▲32,700		+1,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲30,000		▲31,400		+2,000		+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	国庫短期証券買入(10/6-)
国債買入		+12,000				+4,700			+0.005%按分(68.9%) 10,002億
国庫短期証券買入						+10,000			国債買入(10/6-)
国債買現先									(残存1年以下)
共通担保(本店)			▲1,800	+1,500					▲0.005%按分(53.4%) 701億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									+0.001%按分(85.4%) 4,007億
CP等買入	▲100		▲400						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入		+200							12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給									ノーオペ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲17,900		▲32,100		+16,700		+1,000		
当座預金残高	2,405,700		2,373,600		2,390,300		2,391,300		
準備預金残高	2,188,000								
積み終り先	1,808,000								共通担保(本店) 0
超過準備	1,808,000								共通担保(全店) 62,701
非準備先残高	217,700								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	63.3%		予想込増減 ▲32,100		予想込増減 +16,700		予想込増減 +1,000		成長基盤強化 51,360
乖離率	36.6%		当預見込 2,373,600		当預見込 2,390,300		当預見込 2,391,300		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  
10/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,800  
10/5 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	レボG.C
オフア	0.125	-	0.060	0.070
ビット	0.075	-	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

10/1 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,386,200**

(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%

10/1 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	198,528	-5,639	
	132,807	-15,441	
	65,721	+9,802	

\*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	0.030	0.050	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.121	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	-	-	-	0.110	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.045	0.092	-	0.056	0.049	0.045	0.041	-	0.020	0.036	0.047

## § 10/5 オフアのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は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。

## 10/5 の予定(国内)

8:50 8月の都道府県別預金・現金・貸出金 (日銀)

## 10/5 の予定(海外)

米 9月のISM非製造業指数  
FRBの9月の労働市場情勢指数

10:30 8月の毎月勤労統計・速報(厚労省)

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								
◎	ノーオペ	▲32,100	2,373,600	+2,373,600	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	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
2015/9/24 ~ 2015/12/21	8,000	1,300	1,300	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
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率		
2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	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								
2015/9/7 ~ 2015/12/7	8,000	580	580	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								
2015/9/4 ~ 2015/12/15	15,000	8,210	8,210	0.10%	固定金利	-	札割れ																
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																

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