

DAILY SIGNAL

§ 10/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは186兆2,000億円。

本日の無担保コールON物は朝方0.077%の出会いから始まり、その後は0.075～0.077%で推移した。一巡後はビッドが徐々に薄くなり、後場にかけて、0.07～0.075%の出会いが散見され引けた。

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

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,862,000	+1,862,000

(単位:億円)

	日銀速報 10/27(火)		日銀予想 10/28(水)		当社需給予想 10/29(木) 10/30(金)				10/27 のオペ結果
券	▲600		▲800		▲1,000		▲1,000		9:20 ノーオペ
財政	+3,600		+800		▲3,000		▲1,000		10:40 米ドル資金供給(10/29-11/6)
過不足	+3,000		+0		▲4,000		▲2,000		利率0.620% 0百万米ドル
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	10:40 CP等買入(10/30-)
国債買入		+12,100							0.073%全取 3993億
国庫短期証券買入		+15,000							10:40
国債買現先									CP等買入(10/30-)
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲100						ノーオペ
社債等買入			▲100						
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給									
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+29,900		▲200		▲4,000		+2,000		
当座預金残高	2,476,100		2,475,900		2,471,900		2,473,900		
準備預金残高	2,256,000								共通担保(本店) 0
積み終了先	1,855,100		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 66,122
超過準備	1,853,700								国債買現先 0
非準備預金残高	220,100								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.6%								成長基盤強化 51,360
平均	38.7%		予想込増減 ▲200		予想込増減 ▲4,000		予想込増減 +2,000		被災地金融機関支援 3,161
乖離率	60.9%		当預見込 2,475,900		当預見込 2,471,900		当預見込 2,473,900		ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,019,500

10/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,200

10/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	10/20
長期国債	142	202	267
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	6.3
J-REIT	0.14	0.18	0.26
貸出支援基金	9.2	25	30
国庫短期証券	40	49	43
その他とも資産計	224	300	367
銀行券	90	93	92
当座預金	107	178	242
その他とも負債・純資産計	224	300	367

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
10/22	566(3M)	-0.0037%	-0.0044%
10/16	565(1Y)	-0.0358%	-0.0418%
10/15	564(3M)	-0.0037%	-0.0055%

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.125	0.050	0.060	0.065
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

10/26 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,414,600

10/26 のコール市場残高(前日比)			
合計	196,538	-2,297	
有担	132,482	-729	
無担	64,056	-1,568	

*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	0.072	-	-	0.065	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	0.165	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.081	-	-	0.117	-	0.200	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.047	0.067	-	0.043	0.043	0.040	0.039	-	0.008	0.031	0.043

§ 10/28 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台後半で取引されるだろう。

共通担保オペは期落ちなく、見送りを予想する。

10/28 の予定(国内)

なし

10/28 の予定(海外)

米 FOMCの結果
ドイツ ECB副総裁の講演(ベルリン)

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
◎ ノーオペ	▲200	2,475,900	+2,475,900	0.050	0.075	0.075	0.075	0.075	0.118	0.119
				～	～	～	～	～	～	～
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.140	0.155	0.160

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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率					
2015/10/26 ～ 2016/1/25		8,000	3,331	3,331	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					
2015/10/19 ～ 2016/1/18		8,000	1,980	1,980	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					
2015/10/14 ～ 2016/1/22		15,000	9,101	9,101	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ																						
2015/10/13 ～ 2016/1/12		8,000	600	600	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	10/29 ～ 11/6		担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応れなし					
2015/10/9 ～ 2016/1/19		15,000	3,393	3,393	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/22 ～ 10/29		担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応れなし														
2015/10/5 ～ 2016/1/4		8,000	1,500	1,500	0.10%	固定金利	-	札割れ																							
2015/9/24 ～ 2015/12/21		8,000	1,300	1,300	0.10%	固定金利	-	札割れ																							
2015/9/11 ～ 2015/12/22		15,000	230	230	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