

DAILY SIGNAL

平成27年10月28日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/28 のオペと市場動向

本日8時発表の準備預金残高見込みは186兆1,000億円。
無担保コールON物は朝方0.077%の出会いからスタート。
その後は0.075~0.077%で推移した。後場では0.07~0.075%のレンジで取引された。
また一部金融機関による試取により、0.08%台の取引が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,861,000	+1,861,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/28 のオペ結果
	10/28(水)		10/29(木)		10/30(金)		11/2(月)		
券	▲800		▲1,200		▲1,000		▲1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(10/30-) (残存10年超25年以下) ▲0.005%按分(73.7%) 2,406億 (残存25年超) ▲0.002%按分(77.1%) 1,404億 (変動利付債) ▲1.510円(19.4%) 1,201億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲2,200		▲1,300		▲1,000		▲10,000		
過不足	▲3,000		▲2,500		▲2,000		▲11,000		
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									
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)							▲1,100		
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲300						
社債等買入	▲100		▲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	▲3,200		▲2,900		+7,000		▲12,100		
当座預金残高	2,472,900		2,470,000		2,477,000		2,464,900		
準備預金残高	2,250,800		2,250,800		2,250,800		2,250,800		
積み残した先	1,853,300		1,853,300		1,853,300		1,853,300		
超過準備	1,853,200		1,853,200		1,853,200		1,853,200		
非準備預金残高	222,100		222,100		222,100		222,100		
準備預金進捗率	99.7%		99.7%		99.7%		99.7%		
平均	41.9%		41.9%		41.9%		41.9%		
乖離率	57.7%		57.7%		57.7%		57.7%		
予想込増減	▲2,900		▲2,900		+7,000		▲4,100		
当預見込	2,470,000		2,470,000		2,477,000		2,472,900		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							66,122		
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							3,161		
ロンハート残高							0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,018,900
10/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,500
10/29 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
オファー	0.125	0.050	0.060	0.005
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.030
出来値	-	-	-	-

10/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,445,000**

(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	回数	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%

10/27 のコール市場残高(前日比)			
合計	198,200		+1,662
有担	133,699		+1,217
無担	64,501		+445

*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	0.060	0.072	0.060	-	0.073	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	0.070	-	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.085	0.061	0.098	0.088	-	-	0.140	-	-	-
東京レボレート	0.045	0.060	-	0.039	0.042	0.040	0.039	-	0.008	0.031	0.042

§ 10/29 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%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペは期落ち分8,000億円がロールされよう。

10/29 の予定(国内)

8:50 9月の鉱工業生産・速報(経産省)
前週の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

10/29 の予定(海外)

米 7~9月GDP1次速報値
週間新規失業保険申請件数
9月中古住宅販売契約

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	▲2,900	2,470,000	+2,470,000	0.050	0.075	0.075	0.075	0.075	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	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	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	4,003	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					期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率			
2015/10/13 ~ 2016/1/12	8,000	600	600	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/29 ~ 11/6	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし	10/22 ~ 10/29	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	0.10%	固定金利	-	札割れ																
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