

DAILY SIGNAL

平成27年9月2日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは176兆9,000億円。
無担保コールON物は朝方0.07%台後半で取引され、調達一巡後は0.07%台前半で推移した。
試し取りにより0.12%台の出し合いが一部でみられたものの、
地合いに与える影響は限定的であった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,769,000	+1,769,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/2 のオペ結果
	9/2(水)		9/3(木)		9/4(金)		9/7(月)		
券	+500		+100		+0		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(9/4-) (残存1年超3年以下) +0.006%按分(29.4%) 4,002億 (残存3年超5年以下) +0.003%按分(69.8%) 4,006億 (残存5年超10年以下) +0.000%按分(9.7%) 4,003億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)×固定金利方式 (9/4-12/15) 0.10%(札割れ) 8,210億
財政	▲15,700		▲5,400		+4,000		▲3,000		
過不足	▲15,200		▲5,300		+4,000		▲2,000		
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	+12,000				+12,000				
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)					▲7,200		+8,200		
共通担保(全店)							▲700		
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲100						
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					▲3,800		+6,800		
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲3,400		▲5,500		+20,000		▲2,700		
当座預金残高	2,320,000		2,314,500		2,334,500		2,331,800		
準備預金残高	2,110,000								
積み終了先	1,766,200		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 8,000		
超過準備	1,766,100								
非準備先残高	210,000								
準備預金進捗率	99.8%								
平均	58.1%		予想込増減 ▲5,500		予想込増減 +20,000		予想込増減 +5,300		
乖離率	41.7%		当預見込 2,314,500		当預見込 2,334,500		当預見込 2,339,800		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							64,973		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							48,366		
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) 2,022,700
9/3以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,300
9/3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	0.120	0.100	0.060	0.060
ビッド	0.075	0.020	0.100	0.075
出来値	-	-	-	-

9/1 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,282,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	8/31
長期国債	142	202	258
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	6.0
J-REIT	0.14	0.18	0.25
貸出支援基金	9.2	25	29
国庫短期証券	40	49	49
その他とも資産計	224	300	361
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	231
その他とも負債・純資産計	224	300	361

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
8/27	554(3M)	-0.0020%	-0.0056%
8/20	553(3M)	-0.0059%	-0.0087%
8/18	552(1Y)	-0.0247%	-0.0257%

9/1のコール市場残高(前日比)			
	合計	213,163	+11,324
有担	136,695	-1,834	
無担	76,468	+13,158	

*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	0.072	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.085	-	0.122	0.145	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.042	0.060	-	0.056	0.051	0.045	0.034	-	0.036	0.041	0.049

9/3 オファターのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台後半での推移か。
T+2スタートの共通担保オペが実施されると予想する。

9/3 の予定(国内)

木内日銀審議委員講演
(青森県金融経済懇談会)

9/3 の予定(海外)

米 新規失業保険申請件数
8月のISM非製造業指数

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出し合いレンジ予想															
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	▲5,500	2,314,500	+2,314,500	0.055	0.075	0.075	0.080	0.085	0.117	0.118	0.130	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
2015/9/4 ~ 2015/12/15	15,000	8,210	8,210	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
2015/9/1 ~ 2015/12/11	15,000	8,450	8,450	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/8/31 ~ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	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
2015/8/28 ~ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/8/24 ~ 2015/11/24	8,000	2,691	2,691	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/8/17 ~ 2015/11/16	8,000	1,240	1,240	0.10%	固定金利	-	札割れ	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
2015/8/10 ~ 2015/11/9	8,000	2,381	2,381	0.10%	固定金利	-	札割れ	9/3 ~ 9/11	担保範囲内	0	0	0.640%	固定金利	-	応札なし
2015/8/3 ~ 2015/11/2	8,000	1,065	1,065	0.10%	固定金利	-	札割れ	8/27 ~ 9/3	担保範囲内	2	2	0.640%	固定金利	-	1.00

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