

DAILY SIGNAL

平成27年9月14日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

9/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは179兆2,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%の出合いから始まり、その後は
0.075~0.077%で推移した。一巡後も出合いの水準は変わらず、
後場にかけて調整程度の出合いが見られて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,792,000	+1,792,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/14 のオペ結果
	9/14(月)		9/15(火)		9/16(水)		9/17(木)		
券	+500		▲900		+0		▲2,000		9:20 ノオベ 9:30 CP等買入(9/17-) 0.058%按分(78.6%) 4991億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補完供給(9/14-9/15) ▲0.400% 1億
財政	▲8,300		▲100		+1,000		+0		
過不足	▲7,800		▲1,000		+1,000		▲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				+8,700					
国庫短期証券買入				+15,000					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲500					+5,000	
社債等買入				+1,000					
ETF買入				+200					
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								▲100	
当座預金増減	▲8,100		+23,400		+1,000		+2,900		
当座預金残高	2,333,800		2,357,200		2,358,200		2,361,100		
準備預金残高	2,133,700								
積み終了先	1,789,800								
超過準備	1,789,800								
非準備先残高	200,100								
準備預金進捗率	100.0%								
平均	96.8%		予想込増減 +23,400		予想込増減 +1,000		予想込増減 +2,900		
乖離率	3.2%		当預見込 2,357,200		当預見込 2,358,200		当預見込 2,361,100		
共通担保オベ当社予想	ノオベ		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							62,533		
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) 2,028,900

9/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0

9/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.050	0.060	0.025
ビッド	0.075	-0.050	0.100	0.045
出来値	-	-	-	-

9/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,297,700

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	9/10
長期国債	142	202	262
CP等	2.2	2.2	2.5
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	6.1
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	47
その他とも資産計	224	300	366
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	234
その他とも負債・純資産計	224	300	366

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
9/10	557(3M)	0.0000%	-0.0032%
9/8	556(6M)	-0.0020%	-0.0080%
9/3	555(3M)	0.0000%	-0.0032%

9/11 のコール市場残高(前日比)

	合計	203,153	+1,491
有担	132,893	+1,748	
無担	70,260	-257	

*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	0.030	-	-	0.076	-	-	-	-	-	-
最高	0.122	0.120	-	-	0.340	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.075	0.130	0.081	0.080	-	0.150	-	-	-	-
東京レボレート	0.033	0.065	-	0.039	0.037	▲0.009	0.002	-	0.034	0.041	0.049

9/15 オファターのオペと市場動向予想

積み最終日となる明日の足許金利は0.07%台後半で
取引されよう。共通担保オベはノオベを予想する。

9/15 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(2日目)
黒田日銀総裁会見(日銀)

9/15 の予定(海外)

米 8月の小売売上高
9月のNY連銀製造業景況感指数
8月の鉱工業生産

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出合いレンジ予想								
即日オペ金額	当預増減	当預残高	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオベ	+23,400	2,357,200	+2,357,200	0.030	0.070	0.070	0.065	0.065	0.117	0.118	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
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	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
2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	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
2015/9/7 ~ 2015/12/7	8,000	580	580	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
2015/9/4 ~ 2015/12/15	15,000	8,210	8,210	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/9/1 ~ 2015/12/11	15,000	8,450	8,450	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ							
2015/8/31 ~ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	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
2015/8/28 ~ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	0.10%	固定金利	-	札割れ	9/11 ~ 9/17	担保範囲内	4	4	0.650%	固定金利	-	1.00
2015/8/24 ~ 2015/11/24	8,000	2,691	2,691	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	-	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