

DAILY SIGNAL

平成27年10月7日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは181兆4000億円だった。
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0.076~0.078%のレンジで取引された。後場に入ると0.07%台半ばの出が散見されて引けた。
本日まで実施されていた日銀金融政策決定会合では金融市場調節方針の現状維持決定された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,814,000	+1,814,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/7 のオペ結果
	10/7(水)		10/8(木)		10/9(金)		10/13(火)		
券	+400		▲1,000		▲2,000		+1,000		9:20
財政	+2,200		▲2,400		+1,000		▲49,000		ノーオペ
過不足	+2,600		▲3,400		▲1,000		▲48,000		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	ノーオペ
国債買入		+12,300							11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(10/7-10/8)
国債買現先									▲0.400% 480億
共通担保(本店)					▲700	+3,400	▲1,100		12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲200			+4,000			共通担保(全店)(固定金利方式)
社債等買入									(10/9-1/19)
ETF買入		+200		+100					0.10%(札割れ) 3393億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		▲500	+500						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+14,400		▲3,000		+5,700		▲49,100		
当座預金残高	2,409,100		2,406,100		2,411,800		2,362,700		
準備預金残高	2,188,200		2,188,200		2,188,200		2,188,200		
積み終了先	1,807,400		1,807,400		1,807,400		1,807,400		共通担保(本店) 0
超過準備	1,807,400		1,807,400		1,807,400		1,807,400		共通担保(全店) 62,401
非準備預金残高	220,900		220,900		220,900		220,900		国債買現先 0
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		CP買現先 0
平均	73.3%		73.3%		73.3%		73.3%		成長基盤強化 51,360
乖離率	26.7%		26.7%		26.7%		26.7%		被災地金融機関支援 3,166
当座預金増減	+14,400		▲3,000		+5,700		▲49,100		ロンハート残高 0
準備預金残高	2,409,100		2,406,100		2,411,800		2,362,700		
積み終了先	1,807,400		1,807,400		1,807,400		1,807,400		
超過準備	1,807,400		1,807,400		1,807,400		1,807,400		
非準備預金残高	220,900		220,900		220,900		220,900		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
平均	73.3%		73.3%		73.3%		73.3%		
乖離率	26.7%		26.7%		26.7%		26.7%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,960,800
10/8以降の残り積み立て額(残り所要)積数 300
10/8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	0.125	-	0.060	0.020
ビッド	0.075	-	0.100	0.040
出来値	-	-	-	-

10/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,355,200

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	9/30
長期国債	142	202	263
CP等	2.2	2.2	2.0
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	47
その他とも資産計	224	300	365
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	365

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
10/6	562(6M)	-0.0181%	-0.0282%
10/1	561(3M)	-0.0110%	-0.0188%
9/24	560(3M)	-0.0160%	-0.0348%

10/6 のコール市場残高(前日比)

	合計	195,459	+4,275
有担	134,448	+3,488	
無担	61,011	+787	

*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	0.070	-	0.070	0.118	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.122	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	0.078	0.080	0.135	0.118	0.170	-	-	-	-
東京レボレート	0.038	0.063	-	0.049	0.048	0.045	0.040	-	0.014	0.035	0.046

§ 10/8 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%台後半での取引となろう。
共通担保オペは8,000億円のロールを予想する。

10/8 の予定(国内)

8:50 8月の国際収支(財務省)
14:00 9月の景気ウッチャー調査(内閣府)
10月の金融経済月報(日銀)

10/8 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
9月16~17日のFOMC議事録
サンフランシスコ連銀総裁の講演

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	▲3,000	2,406,100	+2,406,100	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
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	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
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	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
2015/9/24 ~ 2015/12/21	8,000	1,300	1,300	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			
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/8 ~ 10/16	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし								
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																
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																

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