

DAILY SIGNAL

平成27年10月8日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは180兆7000億円だった。
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0.076~0.078%のレンジで取引された。
後場に入ると0.07%台半ばの出合いが散見されて引けた。

	即日オペ種類	オフアール額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,807,000	+1,807,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/8 のオペ結果
	10/8(木)		10/9(金)		10/13(火)		10/14(水)		
券	▲1,000		▲1,200		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲2,400		▲300		▲49,000		+2,000		ノオベ
過不足	▲3,400		▲1,500		▲48,000		+3,000		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	ノオベ
国債買入									11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(10/8-10/9)
国債買現先									応札 0億
共通担保(本店)									
共通担保(全店)			▲700 +3,400		▲1,100 +600		▲9,100		12:50
CP買現先									ノオベ
CP等買入	▲200		▲300 +4,000						13:00
社債等買入									共通担保(全店)(固定金利方式)
ETF買入									(10/13-1/12)
J-REIT買入									0.10%(札割れ) 600億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+500								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲3,000		+5,100		▲48,500		▲6,100		
当座預金残高	2,406,100		2,411,200		2,362,700		2,356,600		
準備預金残高	2,186,700				共通担保オペ当社予想				共通担保(本店) 0
積み終了先	1,806,200		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +15,000		共通担保(全店) 62,401
超過準備	1,806,200								国債買現先 0
非準備先残高	219,400								CP買現先 0
準備預金進捗率	100.0%								成長基盤強化 51,360
平均	76.7%		予想込増減 +5,100		予想込増減 ▲48,500		予想込増減 +8,900		被災地金融機関支援 3,166
乖離率	23.3%		当預見込 2,411,200		当預見込 2,362,700		当預見込 2,371,600		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,960,800

10/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200

10/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

(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
10/8	563(3M)	-0.0056%	-0.0105%
10/6	562(6M)	-0.0181%	-0.0282%
10/1	561(3M)	-0.0110%	-0.0188%

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オフアール	0.125	0.050	0.060	0.090
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.102
出来値	-	0.010	-	-

10/7 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,369,300

10/7 のコール市場残高(前日比)	合計	有担	無担
合計	200,142	+4,683	
有担	134,936	+488	
無担	65,206	+4,195	

*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	0.020	-	-	0.114	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	-	0.145	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.076	-	0.098	0.130	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	0.040	0.049	-	0.050	0.049	0.043	0.039	-	0.011	0.034	0.045

§ 10/9 オフアールのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台での取引と推測。
共通担保オペは1兆5000億円のロールを予想する。

10/9 の予定(国内)

13:30 8月の特定サービス産業動態(経産省)

10/9 の予定(海外)

米 アトランタ連銀総裁の講演
ヘル IMF・世界銀行総会(11日まで)

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	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオベ	+5,100	2,411,200	+2,411,200	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)				共通担保資金供給(本店)											
期間	オフアール額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オフアール額	応札額	落札額	按分レート	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	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	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
2015/10/5 ~ 2016/1/14	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	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2015/9/24 ~ 2015/12/21	8,000	1,300	1,300	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
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフアール額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2015/9/7 ~ 2015/12/7	8,000	580	580	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	-	応なし
2015/9/4 ~ 2015/12/15	15,000	8,210	8,210	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	-	応なし

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