

DAILY SIGNAL

平成27年10月13日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは175兆8,000億円。
新日銀ネット全面稼働開始日となる本日、無担保コールON物は朝方0.07%中心に取引され、その後も同水準で推移した。調達一巡後は0.07%近辺で散発的に出合い、引けとなった。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,758,000	+1,758,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/13 のオペ結果
	10/13(火)		10/14(水)		10/15(木)		10/16(金)		
券	+900		+1,500		+0		▲1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(10/15-) (残存1年以下) +0.000%按分(84.3%) 700億 (残存5年超10年以下) ▲0.003%按分(98.9%) 4,008億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲55,200		+5,300		+54,000		▲26,000		
過不足	▲54,300		+6,800		+54,000		▲27,000		
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				+12,300		+4,700			
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)	▲1,100	+600	▲9,100	+9,100					
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲400						
社債等買入									
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	▲55,200		+33,700		+58,700		▲27,000		
当座預金残高	2,355,100		2,388,800		2,447,500		2,420,500		
準備預金残高	2,141,400		2,141,400		2,141,400		2,141,400		
積み終了先	1,761,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	1,761,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備先残高	213,700		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
平均	93.3%		93.3%		93.3%		93.3%		
乖離率	6.7%		6.7%		6.7%		6.7%		
共通担保オベ当社予想			予想込増減 +33,700		予想込増減 +58,700		予想込増減 ▲27,000		
当預見込	2,388,800		2,388,800		2,447,500		2,420,500		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							64,611		
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		
ロンバート残高							0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,960,800
10/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
10/14 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
その他も資産計	224	300	365
銀行券	90	93	92
当座預金	107	178	242
その他も負債・純資産計	224	300	365

T-Billの入札結果(直近3回)			
入札日	回号	最高利回り	平均利回り
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	レポG.C
オフア	0.125	0.050	0.060	0.075
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

10/9 時点のマナタリーベース(単位:億円) **3,372,500**

10/9 のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
200,411	+3,386	-1,726
131,839	-	+5,112

*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	0.050	-	-	0.114	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	0.210	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.077	-	-	0.143	-	-	-	-	-	-
東京レポ・レート	0.048	0.073	-	0.055	0.053	0.045	0.041	-	0.010	0.034	0.045

§ 10/14 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台半ばで推移しよう。
共通担保オベ実施は見送られると予想する。

10/14 の予定(国内)

10:00 日銀営業毎旬報告(10月10日現在)
17:00頃 日銀が保有する国債の銘柄別残高
日銀による国庫短期証券の銘柄別買入額

10/14 の予定(海外)

米 ページアップ
9月のPPI、小売売上高
MBA住宅ローン申請指数

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	+33,700	2,388,800	+2,388,800	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	オフア額	応札額	落札額	按分レト	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	倍率																
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	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	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	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
2015/10/13 ~ 2016/1/12	8,000	600	600	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	2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	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								
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	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	2015/9/7 ~ 2015/12/7	8,000	580	580	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								
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	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	2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	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								

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