

DAILY SIGNAL

平成27年10月14日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは178兆9,000億円。
無担保コールON物は朝方0.07%台後半で取引され、その後も同水準で推移した。
後場に入ってから0.07%台前半の出合いが散見され、引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,789,000	+1,789,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/14 のオペ結果
	10/14(水)		10/15(木)		10/16(金)		10/19(月)		
券	+1,400		▲700		▲1,000		+0		9:20 ノーオペ
財政	+5,500		+50,000		▲26,000		+1,000		9:40 米ドル資金供給 (10/16-10/22) 利率0.620% 0百万米ドル
過不足	+6,900		+49,300		▲27,000		+1,000		10:10 ノーオペ
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	10:40 社債等買入(10/20-) 0.065%按分(55.4%) 1,250億円
国債買入		+12,300		+4,800					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入		+15,000							13:00 ノーオペ
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲9,100	+9,100					▲1,000		
CP買現先			▲600						
CP等買入	▲400								
社債等買入				+200					
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	+33,800		+53,700		▲27,000		+0		
当座預金残高	2,388,900		2,442,600		2,415,600		2,415,600		
準備預金残高	2,166,300								共通担保(本店) 0
積み終了先	1,783,400		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 64,612
超過準備	1,783,400								国債買現先 0
非準備先残高	222,600								CP買現先 0
準備預金進捗率	100.0%								成長基盤強化 51,360
平均	96.7%		予想込増減 +53,700		予想込増減 ▲27,000		予想込増減 +8,000		被災地金融機関支援 3,166
乖離率	3.3%		当預見込 2,442,600		当預見込 2,415,600		当預見込 2,423,600		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,960,800
10/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
10/15 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	10/10
長期国債	142	202	266
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	6.3
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	369
銀行券	90	93	92
当座預金	107	178	241
その他とも負債・純資産計	224	300	369

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	レポG.C
オフア	0.125	0.050	0.060	0.080
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

10/13 のコール市場残高(前日比)		
	合計	前日比
有担	197,482	-2,929
無担	131,405	-434
無担	66,077	-2,495

10/13 時点のマナタリーベース(単位:億円) **3,316,400**

*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	0.065	0.070	-	0.070	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.079	-	0.104	0.310	0.140	0.078	-	-	-	-
東京レポ・レート	0.043	0.082	-	0.059	0.054	0.045	0.041	-	0.009	0.032	0.044

§ 10/15 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。
T+2スタートの共通担保オペが実施されると予想する。

10/15 の予定(国内)

8:50 マナタリーサーベイ(8月、日銀)

10/15 の予定(海外)

米 新規失業保険申請件数
NY連銀総裁講演
10月のNY連銀製造業景況感指数

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	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y								
◎	ノーオペ	+53,700	2,442,600	+2,442,600	0.050	0.075	0.075	0.075	0.075	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	平均レト	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	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		
2015/10/13 ~ 2016/1/12	8,000	600	600	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		
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	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		
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	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		
2015/9/24 ~ 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									
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率		
2015/9/8 ~ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/16 ~ 10/22	担保範囲内	0	0	0.620%	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	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