

DAILY SIGNAL

§ 10/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは182兆3,000億円。
無担保コールON物は朝方0.07%台後半の出会い。
調達一巡後は0.07%台前半で取引され、そのまま引けとなった。
ターム物は1W物0.11%台の出会い。

平成27年10月15日(木)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	1,823,000	+1,823,000

(単位:億円)

	日銀速報 10/15(木)		日銀予想 10/16(金)		当社需給予想				10/15 のオペ結果 9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(10/19-) (残存1年超3年以下) +0.006%按分(24.8%) 4,006億 (残存3年超5年以下) +0.003%按分(5.3%) 4,008億 (残存10年超25年以下) +0.005%按分(79.9%) 2,408億 (残存25年超) +0.006%按分(4.4%) 1,404億 11:50 国債補完供給 (10/15-10/16) ▲0.40%(全取) 5億 12:50 ノーオペ 13:00 共通担保(全店)×固定金利方式) (10/19-1/18) 0.10%(札割れ) 1,980億
					10/19(月)		10/20(火)		
券	▲800		▲900		+0		+0		
財政	+50,100		▲22,900		+1,000		▲18,000		
過不足	+49,300		▲23,800		+1,000		▲18,000		
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		+4,800				+11,800			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)					▲1,000	+2,000			
CP買現先									
CP等買入	▲600		▲400						
社債等買入			▲400						
ETF買入		+200					+1,300		
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	+53,700		▲24,600		+13,800		▲16,700		
当座預金残高	2,442,600		2,418,000		2,431,800		2,415,100		
準備預金残高	2,217,300		2,217,300		2,217,300		2,217,300		
積み終了先	1,818,600		1,818,600		1,818,600		1,818,600		
超過準備	1,818,600		1,818,600		1,818,600		1,818,600		
非準備先残高	225,300		225,300		225,300		225,300		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
平均	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		
予想込増減	▲24,600		▲24,600		+13,800		▲16,700		
当預見込	2,418,000		2,418,000		2,431,800		2,415,100		

共通担保オペ当社予想			
ノーオペ		ノーオペ	

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,019,500
10/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,019,500
10/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 65,100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.125	0.050	0.060	0.080
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

10/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,348,800

(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
10/15	564(3M)	-0.0037%	-0.0055%
10/8	563(3M)	-0.0056%	-0.0105%
10/6	562(6M)	-0.0181%	-0.0282%

10/14 のコール市場残高(前日比)

合計	195,113	-2,369
有担	133,139	+1,734
無担	61,974	-4,103

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.078	-	-	-	-	0.140	0.630	-	-	-
東京レボ・レート	0.043	0.082	-	0.061	0.050	0.044	0.040	-	0.008	0.031	0.044

§ 10/16 オファーのオペと市場動向予想

積み初日となる明日、足許金利は0.07%台後半で
推移しよう。共通担保オペは見送りを予想する。

10/16 の予定(国内)

15:35 黒田日銀総裁挨拶(全国信用組合大会)
17:00 業態別の日銀当座預金残高(9月)

10/16 の予定(海外)

米 9月の鉱工業生産
9月の設備稼働率
10月のミシガン消費者信頼感

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
◎ ノーオペ	▲24,600	2,418,000	+2,418,000	0.050	0.075	0.075	0.075	0.075	0.118	0.119
				~	~	~	~	~	~	~
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.140	0.155	0.160

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	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					
2015/10/19 ~ 2016/1/18		8,000	1,980	1,980	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					
2015/10/14 ~ 2016/1/22		15,000	9,101	9,101	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	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																							
2015/10/9 ~ 2016/1/19		15,000	3,393	3,393	0.10%	固定金利	-	札割れ																							
2015/10/5 ~ 2016/1/4		8,000	1,500	1,500	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																							
2015/9/11 ~ 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																							
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	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					
10/16 ~ 10/22		担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応れなし	10/8 ~ 10/16		担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応れなし														

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