

DAILY SIGNAL

平成27年10月16日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは180兆3,000億円。
無担保コールON物は朝方0.077%近辺で取引され、その後も同水準で推移した。
後場に入ってから0.07%台半ばの出合いが見られ、そのまま引けた。
本日入札が実施された国庫短期証券(1Y、565回債)の最高落札利回りは▲0.0358%と、
1年物として過去最低を更新した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,803,000	+1,803,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/16 のオペ結果
	10/16(金)		10/19(月)		10/20(火)		10/21(水)		
券	▲900		+100		+0		▲1,000		9:20
財政	▲23,000		+4,400		▲18,000		+0		ノーオペ
過不足	▲23,900		+4,500		▲18,000		▲1,000		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				+12,000					12:50
国庫短期証券買入									ノーオペ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)			▲1,000	+2,000					ノーオペ
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲100						
社債等買入	▲400					+1,300			
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	▲24,700		+17,400		▲16,700		▲1,000		
当座預金残高	2,417,900		2,435,300		2,418,600		2,417,600		
準備預金残高	2,199,000								
積み終了先	1,739,100		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,172,000								共通担保(全店) 64,612
非準備先残高	218,900								国債買現先 0
準備預金進捗率	93.5%								CP買現先 0
平均	3.2%		予想込増減 +17,400		予想込増減 ▲16,700		予想込増減 ▲1,000		成長基盤強化 51,360
乖離率	90.3%		当預見込 2,435,300		当預見込 2,418,600		当預見込 2,417,600		被災地金融機関支援 3,166
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,019,500
10/19 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 130,800
10/19 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 4,700

(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
10/20	565(1Y)	-0.0358%	-0.0418%
10/15	564(3M)	-0.0037%	-0.0055%
10/8	563(3M)	-0.0056%	-0.0105%

	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	0.075
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

10/15 のコール市場残高(前日比)			
合計	195,640	+527	
有担	135,512	+2,373	
無担	60,128	-1,846	

10/15 時点のマネタリベース(単位:億円) **3,403,300**

*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	-	-	-	-	0.140	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	-	-	0.280	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.080	-	-	-	-	0.163	-	-	-	-
東京レボレート	0.046	0.080	-	0.060	0.048	0.044	0.040	-	0.008	0.031	0.043

§ 10/19 オファターのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は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。

10/19 の予定(国内)

9:30頃 黒田日銀総裁挨拶(支店長会議)
14:00 地域経済報告(さくらレポート)

10/19 の予定(海外)

米 10月のNAHB住宅市場指数

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	
◎	ノーオペ	+17,400	2,435,300	+2,435,300	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	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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				
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	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				
2015/10/13 ~ 2016/1/12	8,000	600	600	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				
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	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				
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/9/24 ~ 2015/12/21	8,000	1,300	1,300	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率				
2015/9/11 ~ 2015/12/22	15,000	230	230	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/16 ~ 10/22	担保範囲内	0	0	0.620%	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	10/8 ~ 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