

DAILY SIGNAL

平成27年10月21日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは183兆1,000億円。
無担保コールON物は朝方0.077%の出会いから始まり、その後は0.074~0.078%で取引された。後場に入るとビッドは薄くなり、調整程度の出合いが散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,831,000	+1,831,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/21 のオペ結果
	10/21(水)		10/22(木)		10/23(金)		10/26(月)		
券	▲1,700		▲2,000		▲2,000		+0		9:20
財政	+4,600		▲12,700		+2,000		+2,000		ノーオペ
過不足	+2,900		▲14,700		+0		+2,000		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	国債買入(10/23-)
国債買入		+12,100				+7,800			(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入		+15,000							+0.003%按分(53.8%) 4,009億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									+0.008%按分(51.5%) 2,403億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先									+0.011%按分(48.6%) 1,404億
CP等買入			▲900	+4,000					11:50
社債等買入	▲100								国債補完供給(10/21-10/22)
ETF買入									応札0億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援					▲100	+100			ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+300								ノーオペ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+30,200		▲11,600		+7,800		▲800		
当座預金残高	2,446,600		2,435,000		2,442,800		2,442,000		
準備預金残高	2,215,200								
積み終了先	1,801,100		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(本店) 0
超過準備	1,799,700								共通担保(全店) 65,632
非準備先残高	231,400								国債買現先 0
準備預金進捗率	97.7%								CP買現先 0
平均	19.4%		予想込増減 ▲11,600		予想込増減 +7,800		予想込増減 +7,200		成長基盤強化 51,360
乖離率	78.3%		当預見込 2,435,000		当預見込 2,442,800		当預見込 2,450,000		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

10/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 47,300

10/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,900

	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	0.070
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.085
出来値	-	-	-	-

10/20 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,378,700

(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	回数	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%

10/20 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	190,322	-623	
	133,990	-810	
	56,332	+187	

*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	0.072	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.088	-	-	0.310	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.046	0.065	-	0.057	0.045	0.042	0.040	-	0.008	0.031	0.043

§ 10/22 オファターのオペと市場動向予想

足許金利は引き続き0.07%台半ばで取引されよう。
共通担保オペは8,000億円のロールを予想する。

10/22 の予定(国内)

8:50 対外対内証券売買契約等の状況(財務省)
10:00 10月20日現在の営業毎旬報告(日銀)
10:30 8月の毎月勤労統計・確報(厚労省)

10/22 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
9月の景気先行指数

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	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	▲11,600	2,435,000	+2,435,000	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	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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	米ドル資金供給オペ						期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率		
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/22 ~ 10/29	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし	10/16 ~ 10/22	担保範囲内	0	0	0.620%	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																
2015/9/24 ~ 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																

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