

DAILY SIGNAL

平成27年10月22日(木)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは181兆7,000億円。
無担保コールON物は朝方0.076%の出会いから始まり、その後も0.07%台後半で推移した。後場に入っても地合いに変化は見られず引けた。
ターム物は1W物で0.11%台後半の出会い。

	即日オペ種類	オフー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,817,000	+1,817,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/22 のオペ結果
	10/22(木)		10/23(金)		10/26(月)		10/27(火)		
券	▲2,200		▲2,000		+0		+0		9:20
財政	▲13,800		+2,800		+2,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲16,000		+800		+2,000		+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				+8,000					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)									共通担保(全店)(固定金利方式)
共通担保(全店)									(10/26-1/25)
CP買現先					▲2,800	+3,300			0.10%(札割れ) 3,331億
CP等買入	▲900	+4,000	▲300						13:50
社債等買入			▲400						国債補完供給(10/22-10/23)
ETF買入				+200					応札0億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出			▲100	+100					
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	▲12,900		+8,300		+2,500		+1,000		
当座預金残高	2,433,700		2,442,000		2,444,500		2,445,500		
準備預金残高	2,216,200								
積み終了先	1,806,200								共通担保(本店) 0
超過準備	1,804,200								共通担保(全店) 65,632
非準備預金残高	217,500								国債買現先 0
準備預金進捗率	98.3%								CP買現先 0
平均	22.6%		予想込増減 +8,300		予想込増減 +2,500		予想込増減 +1,000		成長基盤強化 51,360
乖離率	75.7%		当預見込 2,442,000		当預見込 2,444,500		当預見込 2,445,500		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
10/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 35,200
10/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,500

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

10/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,410,700**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	10/20
長期国債	142	202	267
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	6.3
J-REIT	0.14	0.18	0.26
貸出支援基金	9.2	25	30
国庫短期証券	40	49	43
その他とも資産計	224	300	367
銀行券	90	93	92
当座預金	107	178	242
その他とも負債・純資産計	224	300	367

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
10/22	566(3M)	-0.0037%	-0.0044%
10/16	565(1Y)	-0.0358%	-0.0418%
10/15	564(3M)	-0.0037%	-0.0055%

10/21 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	189,797	-525	
	134,069	+79	
	55,728	-604	

*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	0.075	-	0.098	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.082	0.125	0.117	0.160	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.048	0.084	-	0.049	0.044	0.042	0.040	-	0.009	0.031	0.043

§ 10/23 オフーのオペと市場動向予想

3日積みとなる明日の足許金利は0.07%台後半で取引されよう。共通担保オペはノーオペを予想する。

10/23 の予定(国内)

14:00 8月の景気動向指数改訂値(内閣府)
16:00 10月の金融システムレポート(日銀)

10/23 の予定(海外)

米 10月の製造業PMI速報

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	+8,300	2,442,000	+2,442,000	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	オフー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	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				
2015/10/19 ~ 2016/1/18	8,000	1,980	1,980	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				
2015/10/14 ~ 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				
2015/10/13 ~ 2016/1/12	8,000	600	600	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				
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/10/5 ~ 2016/1/14	8,000	1,500	1,500	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2015/9/24 ~ 2015/12/21	8,000	1,300	1,300	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				
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				

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。 上田八木証券株式会社 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