

DAILY SIGNAL

平成27年10月23日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは182兆8,000億円。
3日積みとなる本日の無担保コールON物は朝方0.078%の出会いから始まり、
その後は0.075~0.078%で取引された。後場に入り、一部調整程度の
出会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	-	-	1,828,000	+1,828,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/23 のオペ結果
	10/23(金)		10/26(月)		10/27(火)		10/28(水)		
券	▲2,000		+100		+0		+0		9:20 ノオベ 10:10 国庫短期証券買入(10/27-) +0.003%按分(71.9%) 15,001億 国債買入(10/27-) (残存1年超3年以下) +0.005%按分(99.8%) 4,001億 (残存3年超5年以下) ▲0.003%按分(70.1%) 4,001億 (残存5年超10年以下) ▲0.003%按分(54.1%) 4,009億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+1,500		+6,000		+1,000		▲1,000		
過不足	▲500		+6,100		+1,000		▲1,000		
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		+8,000				+12,000			
国庫短期証券買入						+15,000			
国債買現先									
共通担保(本店)			▲2,800	+3,300					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲700						
社債等買入	▲400		▲100						
ETF買入		+200							
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	+7,000		+5,800		+28,000		▲1,000		
当座預金残高	2,440,700		2,446,500		2,474,500		2,473,500		
準備預金残高	2,223,600								
積み終了先	1,819,000								
超過準備	1,815,800								
非準備先残高	217,100								
準備預金進捗率	99.3%								
平均	32.3%		予想込増減 +5,800		予想込増減 +28,000		予想込増減 ▲1,000		
乖離率	67.1%		当預見込 2,446,500		当預見込 2,474,500		当預見込 2,473,500		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,019,500
10/26 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 13,400
10/26 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 600

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.125	0.050	0.060	0.050
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.065
出来値	-	-	-	-

10/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,399,900

(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	回数	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%

10/22 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	189,488	-309	
	133,871	-198	
	55,617	-111	

*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	-	-	0.075	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	0.145	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.081	-	0.100	0.081	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.055	0.086	-	0.048	0.045	0.042	0.040	-	0.009	0.031	0.043

§ 10/26 オフアのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.07%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペは見送りを予想する。

10/26 の予定(国内)

11:00 金融システムレボート別冊「マクロ・ストレス・テスト
のシナリオ設定について」(日銀)

10/26 の予定(海外)

米 9月の新築住宅販売件数
独 10月のIFO景況感指数

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	+5,800	2,446,500	+2,446,500	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	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
2015/10/26 ~ 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	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/10/19 ~ 2016/1/18	8,000	1,980	1,980	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
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ					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			
2015/10/13 ~ 2016/1/12	8,000	600	600	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								
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	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								
2015/10/5 ~ 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																

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