

DAILY SIGNAL

§ 10/19 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0.076%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、一部調整程度のお合いが散見され引けた。
本日公表された日銀地域経済報告では、全9地域の景気判断が前回報告(7月)から据え置かれた。

(単位:億円)

平成27年10月19日(月)
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	所要対比
8:00	-	-	1,823,000	+1,823,000

	日銀速報 10/19(月)		日銀予想 10/20(火)		当社需給予想 10/21(水) 10/22(木)				10/19 のオペ結果
券	▲100		▲700		▲1,000				9:20 ノーオペ
財政	+1,100		▲15,600		+0				10:10 国庫短期証券買入(10/21-)
過不足	+1,000		▲16,300		▲1,000				+0.008%按分(89.5%) 15,002億
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(10/21-)
国債買入		+12,000				+12,000			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入						+15,000			+0.005%按分(20.3%) 4,004億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)	▲1,000	+2,000							+0.006%按分(11.0%) 4,006億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先			▲500						+0.008%按分(23.3%) 4,008億
CP等買入	▲100		▲100	+1,300				+4,000	10:40
社債等買入				+100					CP等買入(10/22-)
ETF買入									0.068%全取 4000億
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援貸出									国債補完供給(10/19-10/20)
国債補完供給		▲100	+100						▲0.40%(全取)100億
成長基盤強化支援貸出増加支援									12:50
									ノーオペ
									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	+13,800		▲15,400		+26,000				共通担保(本店) 0
当座預金残高	2,431,700		2,416,300		2,442,300				共通担保(全店) 65,632
準備預金残高	2,211,200		2,211,200		2,211,200				国債買現先 0
積み終了先	1,784,300		1,784,300		1,784,300				CP買現先 0
超過準備	1,765,700		1,765,700		1,765,700				成長基盤強化 51,360
非準備先残高	220,500		220,500		220,500				被災地金融機関支援 3,166
準備預金進捗率	95.7%		95.7%		95.7%				ロンバート残高 0
平均	12.9%		12.9%		12.9%				
乖離率	82.8%		82.8%		82.8%				

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,019,500
10/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 86,700
10/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 3,200

	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	0.060
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.070
出来値	-	-	-	-

10/16 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,379,600

(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%

10/16 のコール市場残高(前日比)		
合計	193,254	-2,386
有担	135,133	-379
無担	58,121	-2,007

*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	0.070	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.121	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	-	0.099	0.340	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.047	0.089	-	0.061	0.049	0.044	0.040	-	0.008	0.031	0.043

§ 10/20 オファーのオペと市場動向予想

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。

10/20 の予定(国内)

9:00 9月の公社債投資家別売買状況(日証協)
14:30 9月の全国百貨店売上高(百貨店協会)
16:00 9月のコンビニ売上高(日本FC協会)

10/20 の予定(海外)

米 9月の住宅着工件数
9月の住宅建設許可件数
NY連銀総裁とパウエルFRB理事の講演

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	▲15,400	2,416,300	+2,416,300	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				
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		
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	0.10%	固定金利	-	札割れ		
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		

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		
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		
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		
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	-	札割れなし		
10/8 ~ 10/16	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	札割れなし		

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