

DAILY SIGNAL

§ 10/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは179兆6,000億円。
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0.076～0.077%の狭いレンジで取引された。
後場に入り、一部0.07%台前半での出会いが散見され引けた。

平成27年10月20日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オフア－額	準預残見込	所要対比
8:00	-	-	1,796,000	+1,796,000

(単位:億円)

	日銀速報 10/20(火)		日銀予想 10/21(水)		当社需給予想				10/20 のオペ結果
					10/22(木)		10/23(金)		
券	▲600		▲1,600		▲2,000		▲2,000		9:20 ノーオペ
財政	▲15,300		+7,200		▲14,000		+2,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲15,900		+5,600		▲16,000		+0		10:40 米ドル資金供給(10/22-10/29) 利率0.620% 0百万米ドル
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	11:50 国債補完供給(10/20-10/21) ▲0.40%(全取)252億
国債買入				+12,100					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入				+15,000					13:00 ノーオペ
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲500					+4,000			
社債等買入	▲100	+1,300	▲100						
ETF買入		+100							
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	+100	▲300	+300						
当座預金増減	▲15,300		+32,900		▲12,000		+0		
当座預金残高	2,416,400		2,449,300		2,437,300		2,437,300		
準備預金残高	2,189,300								
積み終了先	1,772,500		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,767,900								共通担保(全店) 65,632
非準預先残高	227,100								国債買現先 0
準備預金進捗率	96.8%								CP買現先 0
平均	16.1%		予想込増減	+32,900	予想込増減	▲12,000	予想込増減	+0	成長基盤強化 51,360
乖離率	80.7%		当預見込	2,449,300	当預見込	2,437,300	当預見込	2,437,300	被災地金融機関支援 3,166
									ロンバード残高

今 積み期間の所要準備額(積数)	2,019,500
10/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数)	64,500
10/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均)	2,500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフアー	0.125	0.050	0.060	0.055
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.065
出来値	-	-	-	-

10/19 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,393,500

(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%

合計	190,945	-2,309
有担	134,800	-333
無担	56,145	-1,976

*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	-	-	0.117	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	0.165	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	-	-	0.141	-	-	-	0.080	-	-
東京レボ・レート	0.047	0.058	-	0.055	0.047	0.042	0.040	-	0.008	0.031	0.043

§ 10/21 オファ-のオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台半ばでの取引となろう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

10/21 の予定(国内)

市場調節に関する懇談会(日銀)

10/21 の予定(海外)

週間のMBA住宅ローン申請指数

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	+32,900	2,449,300	+2,449,300	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			
期間	オフ額	応札額	落札額	按分率	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	オフ額	応札額	落札額	按分率	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%	1.27
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

米ドル資金供給おまけ							
期間	オフ額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
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

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たいとお願ひいたします。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(登録) 第243号 加入協会 日本証券業協会