

DAILY SIGNAL

平成27年11月2日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/2 のオペと市場動向

本日8時発表の準備預金残高見込みは184兆円。
無担保コールON物は朝方0.077%の出しから始まった。
その後は0.075~0.077%のレンジで取引された。
ターム物では2W物で0.11%台後半の出しが見られた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,840,000	+1,840,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/2 のオペ結果
	11/2(月)		11/4(水)		11/5(木)		11/6(金)		
券	▲100		+900		+0		+0		9:20
財政	▲18,700		▲13,400		+5,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲18,800		▲12,500		+5,000		+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	国庫短期証券買入(11/5-)
国債買入		+12,100							+0.000%按分(73.8%) 7,504億
国庫短期証券買入						+7,500			12:50
国債買現先									ノーオペ
共通担保(本店)	▲1,100	+500							13:00
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先			▲100						
CP等買入	▲500								
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+300								
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲7,500		▲12,600		+12,500		+2,000		
当座預金残高	2,464,300		2,451,700		2,464,200		2,466,200		
準備預金残高	2,237,900		2,237,900		2,237,900		2,237,900		
積み終了先	1,840,300		1,840,300		1,840,300		1,840,300		共通担保(本店) 0
超過準備	1,840,300		1,840,300		1,840,300		1,840,300		共通担保(全店) 65,582
非準備先残高	226,400		226,400		226,400		226,400		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.8%		99.8%		99.8%		99.8%		CP買現先 0
平均	61.3%		61.3%		61.3%		61.3%		成長基盤強化 51,360
乖離率	38.5%		38.5%		38.5%		38.5%		被災地金融機関支援 3,161
			予想込増減 ▲12,600	予想込増減 ▲12,600	予想込増減 +12,500	予想込増減 +12,500	予想込増減 +2,000	予想込増減 +2,000	ロンハート残高 0
			当預見込 2,451,700	当預見込 2,451,700	当預見込 2,464,200	当預見込 2,464,200	当預見込 2,466,200	当預見込 2,466,200	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,019,100

11/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,200

11/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	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	0.015
ビッド	0.073	0.010	0.100	0.040
出来値	-	-	-	-

10/30 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,444,300

(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
10/29	567(3M)	-0.0018%	-0.0037%
10/22	566(3M)	-0.0037%	-0.0044%
10/16	565(1Y)	-0.0358%	-0.0418%

10/30 のコール市場残高(前日比)			
合計	194,207	-4,753	
有担	136,038	+1,241	
無担	58,169	-5,994	

*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	0.030	0.072	-	-	0.118	-	0.116	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	0.165	-	0.170	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.078	0.076	-	0.119	0.116	0.125	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.042	0.054	-	0.048	0.045	0.041	0.038	-	0.011	0.031	0.042

§ 11/4 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

11/4 の予定(国内)

日本郵政・ゆうちょ銀・かんぽ生命、東証1部上場

8:50 10月のマネタリーベース(日銀)

10:00 10月31日現在の営業毎旬報告(日銀)

11/4 の予定(海外)

米 10月のADP雇用統計

FRB議長が金融規制に関して下院で議会証言

FRB副議長の講演

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	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	▲12,600	2,451,700	+2,451,700	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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/11/2 ~ 2016/2/1	8,000	525	525	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
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	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
2015/10/19 ~ 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	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	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
2015/10/13 ~ 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							
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/29 ~ 11/6	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし
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

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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/11/2 ~ 2016/2/1	8,000	525	525	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
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	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
2015/10/19 ~ 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	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	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
2015/10/13 ~ 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							
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/29 ~ 11/6	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし
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

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