

DAILY SIGNAL

平成27年11月4日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/4 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183兆1000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%の出合いから始まった。
その後は0.075~0.077%のレンジで取引された。
一部市場参加者から試し取りがあり、0.10%超の取引が散見された。
ターム物では1W物で0.11%台後半の出合いが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,831,000	+1,831,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/4 のオペ結果
	11/4(水)		11/5(木)		11/6(金)		11/9(月)		
券	+1,200		+700		+0		+1,000		9:20
財政	▲15,800		+7,100		+2,000		▲27,000		ノオベ
過不足	▲14,600		+7,800		+2,000		▲26,000		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	国債買入(11/6-)
国債買入									(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+7,500		+11,800			+0.004%按分(99.6%) 4003億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									+0.002%按分(22.7%) 4012億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先									+0.009%按分(85.4%) 2405億
CP等買入	▲100		▲600						(残存25年超)
社債等買入									+0.006%按分(73.1%) 1407億
ETF買入									10:40
J-REIT買入									米ドル資金供給(11/6-11/13)
被災地金融機関支援									利率0.630% 0百万米ドル
貸出				+200					11:50
国債補完供給		▲200							国債補完供給
成長基盤強化支援									(11/4-11/5)
貸出増加支援									▲0.40%(全取) 184億
当座預金増減	▲14,900		+14,900		+13,800		▲28,400		12:50
当座預金残高	2,449,400		2,464,300		2,478,100		2,449,700		ノオベ
準備預金残高	2,229,600		2,229,600		2,229,600		2,229,600		共通担保(本店)
積み終了先	1,827,700		1,827,700		1,827,700		1,827,700		共通担保(全店)
超過準備	1,827,700		1,827,700		1,827,700		1,827,700		国債買現先
非準備先残高	219,800		219,800		219,800		219,800		CP買現先
準備預金進捗率	99.8%		99.8%		99.8%		99.8%		成長基盤強化
平均	64.5%		64.5%		64.5%		64.5%		被災地金融機関支援
乖離率	35.3%		35.3%		35.3%		35.3%		ロンハート残高
当座預金増減	▲14,900		+14,900		+13,800		▲28,400		0
当座預金残高	2,449,400		2,464,300		2,478,100		2,449,700		65,582
準備預金残高	2,229,600		2,229,600		2,229,600		2,229,600		0
積み終了先	1,827,700		1,827,700		1,827,700		1,827,700		0
超過準備	1,827,700		1,827,700		1,827,700		1,827,700		0
非準備先残高	219,800		219,800		219,800		219,800		51,360
準備預金進捗率	99.8%		99.8%		99.8%		99.8%		3,161
平均	64.5%		64.5%		64.5%		64.5%		0
乖離率	35.3%		35.3%		35.3%		35.3%		0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,019,100

11/5 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 3,900

11/5 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 400

	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	0.020
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.040
出来値	-	-	-	-

11/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,437,000

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	10/31
長期国債	142	202	271
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	6.4
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	46
その他とも資産計	224	300	374
銀行券	90	93	93
当座預金	107	178	247
その他とも負債・純資産計	224	300	374

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%

11/2 のコール市場残高(前日比)			
合計	203,414	+9,207	
有担	136,017	-21	
無担	67,397	+9,228	

*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	-	0.098	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	0.123	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.085	0.079	0.077	0.116	0.310	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.036	0.034	-	0.045	0.044	0.041	0.038	-	0.011	0.031	0.042

§ 11/5 オファターのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペは期落ち分をロールすると予想する。

11/5 の予定(国内)

8:50 10月6-7日の金融政策決定会合議事要旨(日銀)
11月の当座預金増減要因見込み(日銀)

11/5 の予定(海外)

米 FRB副議長、NY連銀総裁、
ラガルドIMF専務理事の講演

ユーロ圏 ECB月報

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出合いレンジ予想								
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
◎ ノオベ	+14,900	2,464,300	+2,464,300	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				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	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
2015/11/2 ~ 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
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	0.10%	固定金利	-	札割れ	11/6 ~ 11/13	担保範囲内	0	0	0.630%	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	10/29 ~ 11/6	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