DAILY SIGNAL

平成27年11月5日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/5 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184兆8000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%の出合いから始まり、
その後は0.075~0.077%のレンジで推移した。
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	-	-	1,848,000	+1,848,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/5 のオペ結果
	11/5(木)		11/6(金)		11/9(月)		11/10(火)		
券	+900		+400		+1,000		+1,000		9:20 ノオベ 10:40 CP等買入(11/10-) 0.065%按分(3.7%) 3496億 11:50 国債補完供給 (11/5-11/6) ▲0.40%(全取) 6億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)×固定金利方式 (11/9-2/8) 0.10%(札割れ) 1683億
財政	+7,300		+9,000		▲27,000		▲19,000		
過不足	+8,200		+9,400		▲26,000		▲18,000		
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				+12,100					
国庫短期証券買入		+7,500							
国債買現先					▲2,400	+1,700			
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先	▲600		▲300					+3,500	
CP等買入									
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	+200								
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+15,300		+21,200		▲26,700		▲14,500		
当座預金残高	2,464,700		2,485,900		2,459,200		2,444,700		
準備預金残高	2,242,600		1,841,000		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	1,841,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	1,841,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備預金残高	222,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	99.8%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	67.7%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
乖離率	32.1%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
予想込増減	+21,200		+21,200		▲26,700		▲14,500		
当預見込	2,485,900		2,485,900		2,459,200		2,444,700		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							65,582		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							51,360		
被災地金融機関支援							3,161		
ロンハート残高							0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,019,100

11/6以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 3,500

11/6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
オファー	0.125	0.050	0.060	0.025
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.035
出来値	-	-	-	-

11/4 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,420,800

(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
11/5	568(3M)	-0.0037%	-0.0055%
10/29	567(3M)	-0.0018%	-0.0037%
10/22	566(3M)	-0.0037%	-0.0044%

11/4 のコール市場残高(前日比)			
	合計	214,142	+10,728
有担	134,521	-1,496	
無担	79,621	+12,224	

*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	-	0.116	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.160	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.079	-	0.117	0.118	-	0.600	-	-	-	-
東京レボレート	0.032	0.022	-	0.045	0.044	0.041	0.038	-	0.010	0.031	0.042

§ 11/6 オファターのオペと市場動向予想

週末の足許金利は0.07%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペは期落ち無く、ノオファーを予想。

11/6 の予定(国内)

14:00 9月の景気動向指数速報(内閣府)
未定 黒田日銀総裁が内外情勢調査会で講演

11/6 の予定(海外)

米 10月の雇用統計
ブライードFRB理事の講演

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	+21,200	2,485,900	+2,485,900	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	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	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	
2015/11/9 ~ 2016/2/8	8,000	1,683	1,683	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	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2015/11/2 ~ 2016/2/1	8,000	525	525	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	米ドル資金供給オペ															
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	0.10%	固定金利	-	札割れ	11/6 ~ 11/13		0	0	0.630%	固定金利	-	0	0	0	0.620%	固定金利	-	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
2015/10/19 ~ 2016/1/18	8,000	1,980	1,980	0.10%	固定金利	-	札割れ	10/29 ~ 11/6		0	0	0.630%	固定金利	-	0	0	0	0.620%	固定金利	-	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
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																								

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