

DAILY SIGNAL

平成27年11月9日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/9 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183兆4,000億円。
無担保コールON物は朝方0.076%の出会いから始まり、その後も同水準で推移した。
また、一部金融機関により試し取りが行われ、0.125%の取引が部分的に見られた。
調達一巡後は0.07%台前半で散発的に出会い、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,834,000	+1,834,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/9 のオペ結果
	11/9(月)		11/10(火)		11/11(水)		11/12(木)		
券	+1,200		+900		+0		+0		9:20
財政	▲29,300		▲17,000		+1,000		▲6,000		ノーオペ
過不足	▲28,100		▲16,100		+1,000		▲6,000		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(11/11-)
国債買入				+4,800		+11,800			+0.005%按分(91.0%) 17,502億
国庫短期証券買入						+17,500			国債買入(11/11-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)									+0.004%按分(78.3%) 4,003億
共通担保(全店)	▲2,400	+1,700							(残存3年超5年以下)
CP買現先									+0.007%按分(54.3%) 4,008億
CP等買入	▲200		▲500	+3,500					(残存10年超25年以下)
社債等買入									+0.017%按分(96.1%) 2,406億
ETF買入				+100					(残存25年超)
J-REIT買入									+0.017%按分(24.2%) 1,406億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給									12:50
成長基盤強化支援貸出増加支援									国債補完供給
									(11/9-11/10)
									▲0.40%(全取) 25億
									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	▲29,000		▲8,200		+30,300		▲6,000		
当座預金残高	2,455,500		2,447,300		2,477,600		2,471,600		
準備預金残高	2,236,300		2,236,300		2,236,300		2,236,300		
積み終了先	1,833,900		1,833,900		1,833,900		1,833,900		共通担保(本店) 0
超過準備	1,833,900		1,833,900		1,833,900		1,833,900		共通担保(全店) 64,884
非準備先残高	219,200		219,200		219,200		219,200		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先 0
平均	80.6%		80.6%		80.6%		80.6%		成長基盤強化 51,360
乖離率	19.3%		19.3%		19.3%		19.3%		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) 2,025,400

11/10 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 1,000

11/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 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	0.020
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.040
出来値	-	-	-	-

11/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,454,700

(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
11/6	569(6M)	-0.0315%	-0.0394%
11/5	568(3M)	-0.0037%	-0.0055%
10/29	567(3M)	-0.0018%	-0.0037%

11/6 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	223,265	133,662	89,603
	+5,836	+1,292	+4,544

*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	0.121	-	0.155	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.078	0.082	-	0.118	0.160	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.036	0.080	-	0.047	0.044	0.041	0.039	-	0.010	0.031	0.042

§ 11/10 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台後半で推移しよう。
共通担保オペのオファーは見送られると予想する。

11/10 の予定(国内)

8:50 10月の貸出・預金動向(日銀)

11/10 の予定(海外)

欧 ECB副総裁講演(ブリュッセル)
EU財務相理事会(ブリュッセル)

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y								
◎	ノーオペ	▲8,200	2,447,300	+2,447,300	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	按分率	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート
2015/11/9 ~ 2016/2/8	8,000	1,683	1,683	0.10%	固定金利	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%
2015/11/2 ~ 2016/2/1	8,000	525	525	0.10%	固定金利	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	0.10%	固定金利																		
2015/10/19 ~ 2016/1/18	8,000	1,980	1,980	0.10%	固定金利																		
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	0.10%	固定金利																		
2015/10/13 ~ 2016/1/12	8,000	600	600	0.10%	固定金利																		
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	0.10%	固定金利																		
2015/10/5 ~ 2016/1/4	8,000	1,500	1,500	0.10%	固定金利																		

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