

DAILY SIGNAL

平成27年11月11日(水)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/11 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184兆9,000億円。
無担保コールON物は朝方0.076%の合出から始まり、その後0.07%台後半で推移した。後場に入っても地合いに変化は見られず引けた。
また、一部で試取と見られる動きがあり、0.12%台での合出も見られた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,849,000	+1,849,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/11 のオペ結果
	11/11(水)		11/12(木)		11/13(金)		11/16(月)		
券	+400		▲200		▲1,000		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(11/13-) (残存1年超3年以下) +0.002%按分(86.9%) 4003億 (残存3年超5年以下) +0.006%按分(22.8%) 4009億 (残存5年超10年以下) +0.005%按分(72.8%) 4006億 11:50 国債補完供給 (11/11-11/12) ▲0.400%(全取) 33億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+300		▲3,500		+3,000		▲19,000		
過不足	+700		▲3,700		+2,000		▲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	+12,200				+12,000				
国庫短期証券買入	+17,500								
国債買現先							▲1,200		
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲100				+750		
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									
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+29,900		▲3,800		+14,000		▲18,450		
当座預金残高	2,477,500		2,473,700		2,487,700		2,469,250		
準備預金残高	2,254,300								
積み終了先	1,850,000								
超過準備	1,849,800								
非準備預金残高	223,200								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	87.1%		予想込増減 ▲3,800		予想込増減 +14,000		予想込増減 ▲10,450		
乖離率	12.8%		当預見込 2,473,700		当預見込 2,487,700		当預見込 2,477,250		
共通担保(本店)			ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		0
共通担保(全店)									64,884
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) 2,025,400

11/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100

11/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	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	0.045
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.065
出来値	-	-	-	-

11/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,415,600

(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	回数	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%

11/10 のコール市場残高(前日比)

	合計	225,282	-1,029
有担	135,836	+539	
無担	89,446	-1,568	

*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	0.073	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.078	0.079	-	-	0.310	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.034	0.035	-	0.045	0.044	0.041	0.039	-	0.011	0.031	0.043

§ 11/12 オフア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。
共通担保オペは期落ち分がロールオフアされると予想する。

11/12 の予定(国内)

8:50 9月の機械受注(内閣府)

10月の企業物価指数(日銀)

10:00 11月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

11/12 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数

10月の財政収支

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	▲3,800	2,473,700	+2,473,700	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						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	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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
2015/11/2 ~ 2016/2/1	8,000	525	525	0.10%	固定金利	-	札割れ	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
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/10/19 ~ 2016/1/18	8,000	1,980	1,980	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率	11/13 ~ 11/19	担保範囲内	2	2	0.620%	固定金利	-	1.00
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	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	-	応れなし								
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。 上田八木証券株式会社 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