

DAILY SIGNAL

平成27年11月19日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/19 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは183兆7,000億円。
無担保コールON物は朝方0.077%の出しから始まり、その後も同水準で推移した。
後場からは0.07%近辺で散発的に取引され、引けた。
本日開催された日銀金融政策決定会合では金融政策の現状維持が決定された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,837,000	+1,837,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/19 のオペ結果
	11/19(木)		11/20(金)		11/24(火)		11/25(水)		
券									9:20
財政		▲1,900		▲2,000		+0		▲1,000	ノーオペ
過不足		▲29,900		▲10,200		▲4,000		▲5,000	10:10
金融調節		▲31,800		▲12,200		▲4,000		▲6,000	ノーオペ
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					12:50
国庫短期証券買入									ノーオペ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)									共通担保(全店)(固定金利)
共通担保(全店)									(11/24-2/22)
CP買現先									0.10%(全取) 2,771億円
CP等買入	▲200	+3,500	▲600		▲2,700	+2,800			
社債等買入			▲100						
ETF買入		+300		+100					
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		▲28,200		▲700		▲3,900		▲6,000	
当座預金残高		2,462,700		2,462,000		2,458,100		2,452,100	
準備預金残高		2,235,800							
積み終了先		1,809,600							
超過準備		1,796,500							
非準備預金残高		226,900							
準備預金進捗率		95.0%							
平均		13.3%							
乖離率		81.7%							
予想込増減			▲700		▲3,900		▲6,000		
当預見込		2,462,000		2,458,100		2,452,100			
共通担保オベ当社予想									
共通担保(本店)									0
共通担保(全店)									64,805
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) 1,964,600
11/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 97,600
11/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 3,800

	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	0.065
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.085
出来値	-	-	-	-

11/18 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,458,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	11/10
長期国債	142	202	274
CP等	2.2	2.2	2.3
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	44
その他とも資産計	224	300	374
銀行券	90	93	92
当座預金	107	178	245
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
11/18	572(3M)	-0.0357%	-0.0391%
11/17	571(1Y)	-0.0576%	-0.0655%
11/12	570(3M)	-0.0186%	-0.0301%

11/18 のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
199,885	-3,239	-257
135,164	-257	-2,982
64,721	-	-

*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	-	0.117	0.120	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.118	0.150	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.078	0.082	-	0.117	0.131	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.037	0.075	-	0.044	0.039	0.040	0.039	-	0.008	0.029	0.040

§ 11/20 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。
共通担保オベのオファーは見送られると予想する。

11/20 の予定(国内)

黒田日銀総裁の記者会見要旨
14:00 金融経済月報(11月、日銀)

11/20 の予定(海外)

米 セントリス連銀総裁講演

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	
◎	ノーオペ	▲700	2,462,000	+2,462,000	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	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2015/11/24 ~ 2016/2/22	8,000	2,771	2,771	0.10%	固定金利	-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ				
2015/11/16 ~ 2016/2/15	8,000	1,141	1,141	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				
2015/11/9 ~ 2016/2/8	8,000	1,683	1,683	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				
2015/11/2 ~ 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				
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ											
2015/10/19 ~ 2016/1/18	8,000	1,980	1,980	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	0.10%	固定金利	-	札割れ	11/19 ~ 11/27	担保範囲内	4	4	0.620%	固定金利	-	1.00				
2015/10/13 ~ 2016/1/12	8,000	600	600	0.10%	固定金利	-	札割れ	11/13 ~ 11/19	担保範囲内	2	2	0.620%	固定金利	-	1.00				

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