

DAILY SIGNAL

平成27年11月24日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは182兆円7,000億円。
無担保コールON物は朝方0.077%の出会いから始まり、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。
また、一部で試取と見られる動きがあり、0.12%台での出合も見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,827,000	+1,827,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/24 のオペ結果
	11/24(火)		11/25(水)		11/26(木)		11/27(金)		
券	▲600		▲700		▲2,000		▲2,000		9:20
財政	▲5,400		▲200		+2,000		▲14,000		ノーオペ
過不足	▲6,000		▲900		+0		▲16,000		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(11/26-)
国債買入						+11,000			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+2,500					+0.014% (全取) 3,000億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									+0.008%按分(39.4%) 4,005億
共通担保(全店)	▲2,700	+2,800							(残存5年超10年以下)
CP買現先									+0.003%按分(20.6%) 4,007億
CP等買入	▲400		▲1,000						10:40
社債等買入			▲100						米ドル資金供給(11/27-12/3)
ETF買入		+100		+200					利率0.610% 1百万米ドル
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援貸出									国債補完供給(11/24-11/25)
国債補完供給									応札 0億
成長基盤強化支援貸出増加支援									12:50
									ノーオペ
									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	▲6,200		+700		+11,000		▲16,000		
当座預金残高	2,451,700		2,452,400		2,463,400		2,447,400		
準備預金残高	2,234,200								
積み終了先	1,819,400								共通担保(本店) 0
超過準備	1,819,300								共通担保(全店) 64,885
非準備先残高	217,500								国債買現先 0
準備預金進捗率	98.1%								CP買現先 0
平均	30.0%		予想込増減 +700		予想込増減 +11,000		予想込増減 ▲16,000		成長基盤強化 51,360
乖離率	68.1%		当預見込 2,452,400		当預見込 2,463,400		当預見込 2,447,400		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
11/25 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 38,000
11/25 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 1,800

	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	0.070
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

11/20 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,429,900

(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%

11/20 のコール市場残高(前日比)		
合計	204,476	+9,842
有担	138,406	+1,051
無担	66,070	+8,791

*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	-	-	0.160	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	0.165	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.078	0.083	-	0.130	0.163	-	-	-	0.350	-	-
東京レボレート	0.042	0.084	-	0.046	0.042	0.041	0.039	-	0.007	0.027	0.039

§ 11/25 オファーのオペと市場動向予想

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

11/25 の予定(国内)

8:50 10/30の金融政策決定会合(日銀)
10:00 11/20現在の営業毎旬報告(日銀)
14:00 9月の景気動向指数改定値(内閣府)

11/25 の予定(海外)

米 MBA住宅ローン申請指数
10月の個人消費支出
新規失業保険申請件数

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	2,452,400	+2,452,400	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	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
2015/11/24 ~ 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	2015/11/18 ~ 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	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	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	2012/4/20 ~ 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	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	11/27 ~ 12/3	担保範囲内	1	1	0.610%	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	11/19 ~ 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																

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