

DAILY SIGNAL

平成27年11月26日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは183兆円6,000億円。
無担保コールON物は朝方0.076%の出会いから始まり、
その後は0.076~0.077%のレンジで取引された。
後場に入ると0.07%台前半で散発的に取引され、引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,836,000	+1,836,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/26 のオペ結果
	11/26(木)		11/27(金)		11/30(月)		12/1(火)		
券	▲2,600		▲2,000		+0		▲1,000		9:20
財政	+700		▲15,300		+9,000		▲12,000		ノーオペ
過不足	▲1,900		▲17,300		+9,000		▲13,000		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(11/30-)
国債買入		+11,100				+7,800			(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入									▲0.003%按分(84.6%) 4,008億
国債買現先					▲1,600	+1,300			(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									▲0.005%按分(34.8%) 2,412億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先									▲0.005%按分(53.0%) 1,404億
CP等買入	▲300		▲700			+4,500			
社債等買入									12:50
ETF買入		+100		+200					ノーオペ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									共通担保(全店)×(固定金利)
貸出									(11/30-2/29)
国債補完供給									0.10%(全取) 1,310億円
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+9,000		▲17,800		+21,000		▲13,000		
当座預金残高	2,458,300		2,440,500		2,461,500		2,448,500		
準備預金残高	2,241,800		2,241,800		2,241,800		2,241,800		
積み終了先	1,827,900		1,827,900		1,827,900		1,827,900		
超過準備	1,826,900		1,826,900		1,826,900		1,826,900		
非準備先残高	216,500		216,500		216,500		216,500		
準備預金進捗率	99.0%		99.0%		99.0%		99.0%		
平均	36.7%		36.7%		36.7%		36.7%		
乖離率	62.3%		62.3%		62.3%		62.3%		
共通担保オペ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
									共通担保(全店) 64,885
									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
11/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 19,400
11/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,000

	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	0.060
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.085
出来値	-	-	-	-

11/25 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,422,800**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	11/20
長期国債	142	202	277
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	47
その他とも資産計	224	300	380
銀行券	90	93	93
当座預金	107	178	246
その他とも負債・純資産計	224	300	380

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
11/26	573(3M)	-0.0353%	-0.0863%
11/18	572(3M)	-0.0357%	-0.0391%
11/17	571(1Y)	-0.0576%	-0.0655%

11/25 のコール市場残高(前日比)		
合計	204,010	-3,554
有担	138,674	+733
無担	65,336	-4,287

*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	0.130	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.087	-	0.130	-	-	0.200	-	-	-	-
東京レボレート	0.049	0.080	-	0.047	0.043	0.041	0.039	-	0.007	0.027	0.038

§ 11/27 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。

11/27 の予定(国内)

8:30 10月の完全失業率(総務省)
10月の有効求人倍率(厚労省)
10月全国の消費者物価指数(総務省)

11/27 の予定(海外)

米 感謝祭翌日
為替は通常取引、その他は短縮取引

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	▲17,800	2,440,500	+2,440,500	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	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
2015/11/30 ~ 2016/2/29	8,000	1,310	1,310	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	11/27 ~ 12/3	担保範囲内	1	1	0.610%	固定金利	-	1.00
2015/11/24 ~ 2016/2/22	8,000	2,771	2,771	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	11/19 ~ 11/27	担保範囲内	4	4	0.620%	固定金利	-	1.00
2015/11/16 ~ 2016/2/15	8,000	1,141	1,141	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								
2015/11/9 ~ 2016/2/8	8,000	1,683	1,683	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								
2015/11/2 ~ 2016/2/1	8,000	525	525	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/10/19 ~ 2016/1/18	8,000	1,980	1,980	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	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