

DAILY SIGNAL

平成27年11月30日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは184兆6,000億円。
月末となる本日の無担保コールON物は朝方0.077%の出会いから始まり、
その後は0.076~0.077%の狭いレンジで取引された。
後場に入り、一部調整程度のお合いが0.07%近辺で散見され引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,846,000	+1,846,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/30 のオペ結果
	11/30(月)		12/1(火)		12/2(水)		12/3(木)		
券	▲100		▲500		▲1,000		▲2,000		9:20
財政	+10,100		▲13,500		▲81,000		+3,000		ノオペ
過不足	+10,000		▲14,000		▲82,000		+1,000		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(12/2-)
国債買入		+8,200				+10,800			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+2,500					+0.004%按分(90.0%) 3,003億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)	▲1,600	+1,300							+0.003%按分(20.3%) 4,006億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先			▲100						+0.007%按分(27.9%) 2,410億
CP等買入	▲3,500	+4,500							(残存25年超)
社債等買入									+0.005%按分(8.1%) 1,406億
ETF買入									11:50
J-REIT買入									国債補完供給(11/30-12/1)
被災地金融機関支援				+200					▲0.400%(全取) 199億
貸出									12:50
国債補完供給		▲200							ノオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノオペ
当座預金増減	+18,700		▲11,400		▲71,200		+1,000		
当座預金残高	2,458,600		2,447,200		2,376,000		2,377,000		
準備預金残高	2,249,100		1,843,200		ノオペ		ノオペ		共通担保(本店) 0
積み終了先	1,843,200		ノオペ		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) 64,635
超過準備	1,843,200		ノオペ		ノオペ		ノオペ		国債買現先 0
非準備先残高	209,500		ノオペ		ノオペ		ノオペ		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.6%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		成長基盤強化 51,360
平均	50.0%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		被災地金融機関支援 3,161
乖離率	49.6%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		ロンハート残高 0
当座預金増減	+18,700		▲11,400		▲71,200		+1,000		
当座預金残高	2,458,600		2,447,200		2,376,000		2,377,000		
準備預金残高	2,249,100		1,843,200		ノオペ		ノオペ		
積み終了先	1,843,200		ノオペ		ノオペ		ノオペ		
超過準備	1,843,200		ノオペ		ノオペ		ノオペ		
非準備先残高	209,500		ノオペ		ノオペ		ノオペ		
準備預金進捗率	99.6%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		
平均	50.0%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		
乖離率	49.6%		ノオペ		ノオペ		ノオペ		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,961,300
12/1以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,300
12/1以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	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	0.035
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.050
出来値	-	-	-	-

11/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,418,000**

(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%

11/27 のコール市場残高(前日比)		
合計	202,200	-2,604
有担	139,018	-1,212
無担	63,182	-1,392

*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	0.074	-	0.081	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.125	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.081	-	0.100	0.340	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.041	0.060	-	0.049	0.045	0.042	▲0.030	-	0.008	0.027	0.038

§ 12/1 オフアのオペと市場動向予想

月初となる明日の足許金利は引き続き0.07%後半で取引されよう。
共通担保オペはノオペを予想する。

12/1 の予定(国内)

8:50 7-9月の法人企業統計(財務省)
14:00 11月の新車販売(自販連)

12/1 の予定(海外)

米 11月のISM製造業指数
ソコ 連銀総裁講演
ブレイトードFRB理事講演

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
◎ ノオペ	▲11,400	2,447,200	+2,447,200	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)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	*当日物		
					平均レド	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
2015/11/24 ~ 2016/2/22	8,000	2,771	2,771	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/11/16 ~ 2016/2/15	8,000	1,141	1,141	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/11/9 ~ 2016/2/8	8,000	1,683	1,683	0.10%	固定金利	-	札割れ
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

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	*当日物		
					平均レド	按分率	倍率
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	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
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
米ドル資金供給オペ							
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
11/27 ~ 12/3	担保範囲内	1	1	0.610%	固定金利	-	1.00
11/19 ~ 11/27	担保範囲内	4	4	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