

DAILY SIGNAL

平成27年11月13日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/13 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186兆4,000億円。
週末となる本日の無担保コールON物は朝方0.077%の出合から始まり、その後は
0.077~0.078%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、後場に入って
0.07%台前半の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	着地残対比
8:00	-	-	1,864,000	+1,864,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/13 のオペ結果
	11/13(金)		11/16(月)		11/17(火)		11/18(水)		
券	▲400		+1,100		+0		+0		9:20
財政	+3,300		▲18,900		+2,000		▲1,000		ノーオペ
過不足	+2,900		▲17,800		+2,000		▲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	国庫短期証券買入(11/17-)
国債買入		+12,100				+7,800			▲0.005%按分(28.7%) 15,001億
国庫短期証券買入						+15,000			国債買入(11/17-)
国債買現先									▲0.005%按分(97.6%) 4,006億
共通担保(本店)			▲1,200	+1,100					(残存5年超10年以下)
共通担保(全店)									▲0.013%按分(65.8%) 2,404億
CP買現先									(残存10年超25年以下)
CP等買入	▲900		▲300						▲0.000%按分(66.9%) 1,408億
社債等買入				+800					
ETF買入				+100					
J-REIT買入		+200							
被災地金融機関支援									
貸出									12:50
国債補完供給									ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノーオペ
当座預金増減	+14,300		▲17,300		+24,800		▲1,000		
当座預金残高	2,489,100		2,471,800		2,496,600		2,495,600		
準備預金残高	2,268,100		2,268,100		2,268,100		2,268,100		
積み終了先	1,861,100		1,861,100		1,861,100		1,861,100		共通担保(本店) 0
超過準備	1,861,100		1,861,100		1,861,100		1,861,100		共通担保(全店) 64,884
非準備先残高	221,000		221,000		221,000		221,000		国債買現先 0
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		CP買現先 0
平均	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		成長基盤強化 51,360
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		被災地金融機関支援 3,161
			予想込増減 ▲17,300	予想込増減 +24,800	予想込増減 ▲1,000				ロンハート残高 0
			当預見込 2,471,800	当預見込 2,496,600	当預見込 2,495,600				

来 積み期間の所要準備額(積数) 1,964,600

11/16 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 1,964,600

11/16 以降の残り積み立て額(残り所要)平均) 65,500

	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	0.025
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.050
出来値	-	-	-	-

11/12 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,442,800

(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
11/12	570(3M)	-0.0186%	-0.0301%
11/6	569(6M)	-0.0315%	-0.0394%
11/5	568(3M)	-0.0037%	-0.0055%

11/12 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	225,270	-192	
	134,719	-98	
	90,551	-94	

*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	0.065	0.073	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.078	0.086	-	0.099	0.077	-	-	0.175	0.085	-	-
東京レボ・レート	0.037	0.077	-	0.047	0.044	0.041	0.039	-	0.010	0.031	0.043

§ 11/16 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。

11/16 の予定(国内)

8:50 7~9月のGDP・1次速報(内閣府)

11/16 の予定(海外)

米 11月のNY連銀製造業景況感指数
欧 ユーロ圏10月のCPI

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	▲17,300	2,471,800	+2,471,800	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				
2015/11/16 ~ 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	4,003	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70				
2015/10/19 ~ 2016/1/18	8,000	1,980	1,980	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/10/14 ~ 2016/1/22	15,000	9,101	9,101	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				
2015/10/13 ~ 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				
2015/10/9 ~ 2016/1/19	15,000	3,393	3,393	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	-	応札なし				

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