

DAILY SIGNAL

平成27年12月2日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは177兆6000億円。
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、前場は0.075~0.078%で取引された。また、一部試し取りの動きから0.12%超の出会いも散見された。
後場に入り、一部調整程度の出合いが0.07%近辺で取引され引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,776,000	+1,776,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/2 のオペ結果
	12/2(水)		12/3(木)		12/4(金)		12/7(月)		
券	▲1,000		▲2,000		▲2,000		+0		9:20
財政	▲74,400		+4,800		+6,000		▲4,000		ノーオペ
過不足	▲75,400		+2,800		+4,000		▲4,000		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(12/4-)
国債買入		+11,100				+4,700			(残存1年以下)
国庫短期証券買入									+0.022%按分(63.3%) 700億
国債買現先									(残存5年超10年以下)
共通担保(本店)									▲0.003%按分(93.4%) 4,014億
共通担保(全店)									11:50
CP買現先									国債補完供給(12/2-12/3)
CP等買入	▲200		▲100						▲0.400%(全取) 55億
社債等買入									12:50
ETF買入									ノーオペ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									
国債補完供給		▲100	+100						
成長基盤強化支援					▲4,000	+11,000			
貸出増加支援									
当座預金増減	▲64,600		+2,800		+15,700		▲4,600		
当座預金残高	2,379,500		2,382,300		2,398,000		2,393,400		
準備預金残高	2,169,500								
積み終了先	1,770,800								共通担保(本店) 0
超過準備	1,770,800								共通担保(全店) 64,635
非準備先残高	210,000								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.8%								CP買現先 0
平均	56.7%		予想込増減 +2,800		予想込増減 +15,700		予想込増減 +3,400		成長基盤強化 51,360
乖離率	43.1%		当預見込 2,382,300		当預見込 2,398,000		当預見込 2,401,400		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) 1,961,300
12/3以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,500
12/3以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	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	0.040
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.055
出来値	-	-	-	-

12/1 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,422,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	11/30
長期国債	142	202	279
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	6.5
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	46
その他とも資産計	224	300	381
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	381

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%

12/1 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	198,954	138,899	60,055
	+3,635	+2,077	+1,558

*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	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.078	-	0.124	0.310	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.032	0.039	-	0.043	0.041	0.040	▲0.050	-	0.007	0.027	0.038

§ 12/3 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされると予想する。

12/3 の予定(国内)

木内日銀審議委員講演(資本市場研究会) 8:50
前週の対外対内証券売買(財務省)

12/3 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
11月のISM非製造業指数
FRB議長が米上下両院合同経済委で証言

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	+2,800	2,382,300	+2,382,300	0.050	0.075	0.075	0.075	0.118	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				
2015/11/30 ~ 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				
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				
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	米ドル資金供給オペ											
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	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				
2015/10/19 ~ 2016/1/18	8,000	1,980	1,980	0.10%	固定金利	-	札割れ	12/3 ~ 12/10	担保範囲内	2	2	0.620%	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	11/27 ~ 12/3	担保範囲内	1	1	0.610%	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