

DAILY SIGNAL

平成27年12月7日(月)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは178兆8000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.074~0.076%の水準で取引され、その後はビット
成りや薄くなるも、0.075%近辺で出合った。後場にかけて一部0.07%での取引が
散見され引けた。ターム物は1Wで0.11%台後半の出合いが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,788,000	+1,788,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/7 のオペ結果
	12/7(月)		12/8(火)		12/9(水)		12/10(木)		
券	▲400		▲1,100		▲1,000		▲3,000		9:20
財政	▲900		▲3,600		+3,000		▲10,000		ノーオペ
過不足	▲1,300		▲4,700		+2,000		▲13,000		12:50
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	ノーオペ
国債買入				+11,000					13:00
国庫短期証券買入				+5,000					ノーオペ
国債買現先									13:50
共通担保(本店)	▲600	+500	▲9,400	+13,200					国債補完供給(12/7-12/8)
共通担保(全店)									▲0.400%(全取) 8億
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲300			+5,000			
社債等買入			▲100						
ETF買入		+200		+300					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+100								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲1,400		+15,000		+7,000		▲13,000		
当座預金残高	2,393,300		2,408,300		2,415,300		2,402,300		
準備預金残高	2,173,100		2,173,100		2,173,100		2,173,100		
積み終了先	1,783,900		1,783,900		1,783,900		1,783,900		共通担保(本店) 0
超過準備	1,783,900		1,783,900		1,783,900		1,783,900		共通担保(全店) 64,505
非準備先残高	220,200		220,200		220,200		220,200		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先 0
平均	73.3%		73.3%		73.3%		73.3%		成長基盤強化 58,339
乖離率	26.6%		26.6%		26.6%		26.6%		被災地金融機関支援 3,161
当座預金増減	▲1,400		+15,000		+7,000		▲13,000		被災地金融機関支援 3,161
準備預金残高	2,393,300		2,408,300		2,415,300		2,402,300		ロンハート残高 0
積み終了先	1,783,900		1,783,900		1,783,900		1,783,900		
超過準備	1,783,900		1,783,900		1,783,900		1,783,900		
非準備先残高	220,200		220,200		220,200		220,200		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	73.3%		73.3%		73.3%		73.3%		
乖離率	26.6%		26.6%		26.6%		26.6%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,969,500

12/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,500

12/8以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	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	0.020
ビット	0.075	0.020	0.100	0.030
出来値	-	-	-	-

12/4 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,378,100

(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
12/3	574(3M)	-0.0502%	-0.0644%
11/26	573(3M)	-0.0353%	-0.0863%
11/18	572(3M)	-0.0357%	-0.0391%

12/4 のコール市場残高(前日比)		
合計	213,094	+7,934
有担	140,289	+1,810
無担	72,805	+6,124

*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	0.073	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.155	0.160	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.077	-	0.106	0.116	-	0.170	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.030	0.025	-	0.038	0.038	0.039	▲0.053	-	0.007	0.025	0.037

§ 12/8 オファターのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台で推移しよう。

共通担保オペはノーオペを予想する。

12/8 の予定(国内)

8:50 7-9月期のGDP改定値

10月の国際収支(財務省)

未定 黒田日銀総裁が年末エコノミスト懇親会であいさつ

12/8 の予定(海外)

欧 ユーロ圏 7-9月期GDP確報

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	+15,000	2,408,300	+2,408,300	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	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
2015/12/8 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	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
2015/12/7 ~ 2016/3/7	8,000	450	450	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
2015/11/30 ~ 2016/2/29	8,000	1,310	1,310	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
2015/11/24 ~ 2016/2/22	8,000	2,771	2,771	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
2015/11/16 ~ 2016/2/15	8,000	1,141	1,141	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ					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			
2015/11/9 ~ 2016/2/8	8,000	1,683	1,683	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	12/3 ~ 12/10	担保範囲内	2	2	0.620%	固定金利	-	1.00
2015/11/2 ~ 2016/2/1	8,000	525	525	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	11/27 ~ 12/3	担保範囲内	1	1	0.610%	固定金利	-	1.00
2015/10/26 ~ 2016/1/25	8,000	3,331	3,331	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。 上田八木証券株式会社 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