DAILY SIGNAL

平成27年12月8日(火)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 12/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは180兆7000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%の出合いから始まり、その後は
0.075～0.076%のレンジで取引された。一巡後はビッドが薄くなるも、
一部0.076%の出合いが見られた。また、試し取りによる0.12%台の取引が散見され
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	準預残見込	所要対比
8:00	－	－	1,807,000	+1,807,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想			
	12/8(火)		12/9(水)		12/10(木)		12/11(金)	
券	▲1,300		▲1,400		▲3,000		▲3,000	
財政	▲6,200		+4,500		▲10,000		+1,000	
過不足	▲7,500		+3,100		▲13,000		▲2,000	
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		+11,000						
国庫短期証券買入		+5,000						
国債買現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)	▲9,400	+13,200					▲8,500	
CP買現先								
CP等買入	▲300		▲200	+5,000				
社債等買入	▲100							
ETF買入		+300		+500				
J－REIT買入								
被災地金融機関支援								
貸出								
国債補完供給								
成長基盤強化支援								
貸出増加支援								
当座預金増減	+12,200		+8,400		▲13,000		▲10,500	
当座預金残高	2,405,500		2,413,900		2,400,900		2,390,400	
準備預金残高	2,188,500		共通担保オペ当社予想					
積み終了先	1,800,400		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +15,000	
超過準備	1,800,400							
非準預先残高	217,000							
準備預金進捗率	99.9%							
平均	76.7%		予想込増減	+8,400	予想込増減	▲13,000	予想込増減	+4,500
乖離率	23.2%		当預見込	2,413,900	当預見込	2,400,900	当預見込	2,405,400

12/8 のオペ結果

9:20
ノーオペ
10:40
米ドル資金供給(12/10-12/17)
利率0.630% 3百万米ドル
12:50
ノーオペ
13:50
国債補完供給(12/8-12/9)
▲0.400%(全取) 0億

共通担保(本店)	0
共通担保(全店)	68,305
国債買現先	0
CP買現先	0
成長基盤強化	58,339
被災地金融機関支援	3,161
ロンバート残高	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,969,500
12/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,300
12/9 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	レポG.C
オファー	0.125	0.050	0.060	0.025
ビッド	0.075	0.020	0.100	0.050
出来値	－	－	－	－

12/7 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,377,000

(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
12/8	575(6M)	-0.0378%	-0.0458%
12/3	574(3M)	-0.0502%	-0.0644%
11/26	573(3M)	-0.0353%	-0.0863%

12/7 のコール市場残高(前日比)

合計	216,223	+3,129
有担	142,799	+2,510
無担	73,424	+619

*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	－	0.117	0.065	－	－	－	－	－	－
最高	0.125	0.121	－	0.130	0.165	－	－	－	－	－	－
加重平均	0.076	0.077	－	0.120	0.114	－	－	－	－	－	－
東京レポ・レート	0.023	0.020	－	0.038	0.037	▲ 0.068	▲ 0.051	－	0.008	0.025	0.037

§ 12/9 オファ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。
共通担保オペは期落ちをロールすると予想する。

12/9 の予定(国内)
8:50 10月の機械受注(内閣府)
11月のﾏﾈｰｽﾄｯｸ(日銀)

12/9 の予定(海外)
米 週間のMBA住宅ﾛｰﾝ申請指数

翌営業日の即日オペ予想				
即日オペ金額		当預増減	当預残高	所要対比
◎	ノーオペ	+8,400	2,413,900	+2,413,900

翌営業日の出合いレンジ予想								
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
0.050	0.075	0.075	0.040	0.050	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

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	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
2015/12/7 ～ 2016/3/7	8,000	450	450	0.10%	固定金利	－	札割れ
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

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	按分レート	平均レート	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	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
12/10 ～ 12/17	担保範囲内	3	3	0.630%	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

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