DAILY SIGNAL

平成27年12月9日(水)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 12/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは181兆4000億円だった。
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0.074～0.076%のレンジで取引された。一巡後はビットレートがやや下がり、後場にかけて一部0.07～0.074%の出合いが見られた。
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	準預残見込	所要対比
8:00	－	－	1,814,000	+1,814,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想			
	12/9(水)		12/10(木)		12/11(金)		12/14(月)	
券		▲1,400		▲3,100		▲3,000		▲1,000
財政		+2,500		▲12,600		+1,000		▲8,000
過不足		+1,100		▲15,700		▲2,000		▲9,000
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						+7,800		
国庫短期証券買入								
国債買現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)					▲8,500	+10,400		
CP買現先								
CP等買入	▲200	+5,000	▲400					
社債等買入								
ETF買入		+500		+200				
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		+6,400		▲15,900		+7,700		▲9,000
当座預金残高		2,411,900		2,396,000		2,403,700		2,394,700
準備預金残高		2,202,200	共通担保オペ当社予想					
積み終了先		1,813,600	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ	
超過準備		1,813,600						
非準預先残高		209,700						
準備預金進捗率		99.9%						
平均		80.0%	予想込増減	▲15,900	予想込増減	+7,700	予想込増減	▲9,000
乖離率		19.9%	当預見込	2,396,000	当預見込	2,403,700	当預見込	2,394,700

12/9 のオペ結果

9:20
ノーオペ
10:10
国債買入(12/11-)
(残存5年超10年以下)
▲0.005%按分(23.5%) 4009億
(残存10年超25年以下)
▲0.011%按分(7.4%) 2405億
(残存25年超)
▲0.013%按分(8.1%) 1404億

12:50
ノーオペ
13:00
共通担保(全店)〈固定金利〉
(12/11-3/22)
0.10%(全取) 10400億円

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
12/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,100
12/10 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	0.055
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.065
出来値	－	－	－	－

12/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,390,600

(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%

12/8 のコール市場残高(前日比)

合計	225,749	+9,526
有担	143,995	+1,196
無担	81,754	+8,330

*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	－	－	－	－	－	－	－
最高	0.125	0.125	－	0.125	－	－	－	－	－	－	－
加重平均	0.076	0.082	－	0.117	0.310	－	－	－	－	－	－
東京レポ・レート	0.027	0.064	－	0.038	0.038	▲ 0.063	▲ 0.050	－	0.008	0.025	0.037

§ 12/10 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。
共通担保オペはノーオペ予想。

12/10 の予定(国内)
債券市場参加者会合
(銀行等ｸﾞﾙｰﾌﾟ、証券等グループ)

12/10 の予定(海外)
米 11月輸入物価指数
11月財政収支

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	▲15,900	2,396,000	+2,396,000	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
2015/12/11 ～ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	0.10%	固定金利	－	札割れ
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

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