

DAILY SIGNAL

平成27年12月10日(木)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは179兆7000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.076%の出会いから始まり、その後は0.074~0.076%のレンジで取引された。一巡後はビッドが薄くなり、後場にかけて0.073~0.074%で散発的に取引され引けた。
ターム物は1Wで0.11%台後半の出会いが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,797,000	+1,798,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/10 のオペ結果
	12/10(木)		12/11(金)		12/14(月)		12/15(火)		
券	▲3,200		▲2,500		▲1,000		▲2,000		9:20
財政	▲14,700		+3,200		▲8,000		+53,000		ノーオペ
過不足	▲17,900		+700		▲9,000		+51,000		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	ノーオペ
国債買入				+8,500					12:50
国庫短期証券買入									ノーオペ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)			▲8,500	+10,400			▲8,200		ノーオペ
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲800						
社債等買入									
ETF買入		+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	▲18,100		+10,300		▲9,000		+42,800		
当座預金残高	2,393,800		2,404,100		2,395,100		2,437,900		
準備預金残高	2,182,400								
積み終了先	1,790,000								共通担保(本店) 0
超過準備	1,790,000								共通担保(全店) 68,305
非準備先残高	211,400								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	83.3%		予想込増減 +10,300		予想込増減 ▲9,000		予想込増減 +57,800		成長基盤強化 58,339
乖離率	16.6%		当預見込 2,404,100		当預見込 2,395,100		当預見込 2,452,900		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) 1,969,500

12/11 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 800

12/11 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 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	0.050
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.065
出来値	-	-	-	-

12/9 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,398,400

(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
12/10	576(3M)	-0.0221%	-0.0353%
12/8	575(6M)	-0.0378%	-0.0458%
12/3	574(3M)	-0.0502%	-0.0644%

12/9 のコール市場残高(前日比)

合計	227,446	+1,697
有担	143,694	-301
無担	83,752	+1,998

*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	-	0.080	-	-	0.128	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.117	-	-	0.145	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.079	-	0.110	-	-	0.142	-	-	-	-
東京レボレート	0.037	0.065	-	0.041	0.040	▲0.055	▲0.042	-	0.008	0.026	0.038

§ 12/11 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。
共通担保オペは期落ちを同水準でロールすると予想する。

12/11 の予定(国内)

なし

12/11 の予定(海外)

米 11月の小売売上高
12月のミシガン大学消費者信頼感速報

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	+10,300	2,404,100	+2,404,100	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					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
2015/12/11 ~ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	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
2015/12/8 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	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
2015/12/7 ~ 2016/3/17	8,000	450	450	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
2015/11/30 ~ 2016/2/29	8,000	1,310	1,310	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
2015/11/24 ~ 2016/2/22	8,000	2,771	2,771	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/11/16 ~ 2016/2/15	8,000	1,141	1,141	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	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	12/10 ~ 12/17	担保範囲内	3	3	0.630%	固定金利	-	1.00	12/10 ~ 12/17	担保範囲内	3	3	0.630%	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	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

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