

DAILY SIGNAL

平成27年12月14日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは180兆1000億円だった。本日の無担保コールON物は朝方0.074%の出会いからスタート。その後は0.074~0.077%のレンジで出会いが見られた。後場では0.071~0.075%のレンジで調整程度の取引が散見された。また、試し取りによる0.12%台の取引が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,801,000	+1,801,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/14 のオペ結果
	12/14(月)		12/15(火)		12/16(水)		12/17(木)		
券	▲1,800		▲2,200		▲3,000		▲4,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(12/16-) (残存5年超10年以下) ▲0.008%按分(47.9%) 4007億 (残存10年超25年以下) ▲0.004%按分(93.6%) 2409億 (残存25年超) ▲0.006%按分(55.2%) 1406億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲9,500		+58,700		+3,000		+1,000		
過不足	▲11,300		+56,500		+0		▲3,000		
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				+7,700		+7,800			
国庫短期証券買入				+5,000					
国債買現先									
共通担保(本店)			▲8,200	+8,200					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲800						
社債等買入	▲100		▲400						
ETF買入									
J-REIT買入		+200		+200					
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給					▲500	+20,200			
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲11,500		+68,200		+27,500		▲3,000		
当座預金残高	2,394,600		2,462,800		2,490,300		2,487,300		
準備預金残高	2,188,400		2,188,400		2,188,400		2,188,400		
積み終了先	1,796,400		1,796,400		1,796,400		1,796,400		
超過準備	1,796,400		1,796,400		1,796,400		1,796,400		
非準備預金残高	206,200		206,200		206,200		206,200		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
平均	96.7%		96.7%		96.7%		96.7%		
乖離率	3.3%		3.3%		3.3%		3.3%		
共通担保オベ当社予想	ノオベ		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							70,255		
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		
ロンハート残高							0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,969,500

12/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0

12/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	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	0.055
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.070
出来値	-	-	-	-

12/11 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,398,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	12/10
長期国債	142	202	281
CP等	2.2	2.2	2.5
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	6.7
J-REIT	0.14	0.18	0.27
貸出支援基金	9.2	25	30
国庫短期証券	40	49	45
その他とも資産計	224	300	384
銀行券	90	93	94
当座預金	107	178	239
その他とも負債・純資産計	224	300	384

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	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%

12/11 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	219,486	-833	
	140,777	-2,668	
	78,709	+1,835	

*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	-	-	0.114	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	0.340	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	-	0.128	0.133	0.113	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.037	0.070	-	0.041	0.041	▲0.044	▲0.030	-	0.008	0.026	0.038

§ 12/15 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台で推移しよう。

共通担保オベはノオベ予想。

12/15 の予定(国内)

国債投資家懇談会(財務省)

8:50 12月調査の短観全容・企業の物価見通し(日銀)

12/15 の予定(海外)

米 FOMC(16日まで)

12月のNY連銀製造業景況感指数

11月のCPI

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y								
◎	ノオベ	+68,200	2,462,800	+2,462,800	0.050	0.075	0.040	0.045	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	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率			
2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	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								
2015/12/11 ~ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	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								
2015/12/8 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	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								
2015/12/7 ~ 2016/3/7	8,000	450	450	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								
2015/11/30 ~ 2016/2/29	8,000	1,310	1,310	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ															
2015/11/24 ~ 2016/2/22	8,000	2,771	2,771	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	倍率									
2015/11/16 ~ 2016/2/15	8,000	1,141	1,141	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								
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								

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