

DAILY SIGNAL

平成27年12月15日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは184兆6000億円だった。
本日の無担保コールON物は0.074%の出会いから始まり、その後0.074~0.077%のレンジで取引された。後場では0.07~0.075%で調整程度の出合いが見られた。
本日オフアされた米ドル資金供給オペは1W物が貸付利率0.820%でオフアされ、1億米ドルの応札があり、全額落札された。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	1,846,000	+1,846,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/15 のオペ結果
	12/15(火)		12/16(水)		12/17(木)		12/18(金)		
券	▲2,100		▲2,200		▲4,000		▲4,000		9:20
財政	+57,800		+1,700		+1,000		+2,000		ノーオペ
過不足	+55,700		▲500		▲3,000		▲2,000		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		+7,700		+8,300					10:40
国庫短期証券買入		+5,000							米ドル資金供給(12/17-12/24)
国債買現先									利率0.820% 1億米ドル
共通担保(本店)	▲8,200	+8,200					▲9,200	+5,500	10:40
共通担保(全店)									CP等買入(12/18-)
CP買現先			▲500						0.047%按分(91.0%) 5,480億
CP等買入	▲800								12:50
社債等買入	▲400								ノーオペ
ETF買入		+200							13:00
J-REIT買入									ノーオペ
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			▲11,200	+20,200					
当座預金増減	+67,400		+16,300		▲3,000		▲5,700		
当座預金残高	2,462,000		2,478,300		2,475,300		2,469,600		
準備預金残高	2,250,500								共通担保(本店) 0
積み終了先	1,844,100								共通担保(全店) 70,195
超過準備	1,844,100								国債買現先 0
非準備先残高	211,500								CP買現先 0
準備預金進捗率	100.0%								成長基盤強化 58,339
平均	100.0%		予想込増減 +16,300		予想込増減 ▲3,000		予想込増減 +9,300		被災地金融機関支援 3,161
乖離率	0.0%		当預見込 2,478,300		当預見込 2,475,300		当預見込 2,484,600		ロンハート残高 0

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,040,700
12/16 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 2,040,700
12/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 65,800

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オフア	0.125	0.050	0.060	0.030
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.055
出来値	-	-	-	-

12/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,388,600

(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%

12/14 のコール市場残高(前日比)

	合計	213,195	-6,291
有担	141,931	+1,154	
無担	71,264	-7,445	

*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	-	0.130	0.098	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	0.155	0.165	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	-	0.143	0.110	-	0.155	-	-	-	-
東京レポレート	0.038	0.058	-	0.042	▲0.030	▲0.038	▲0.024	-	0.009	0.027	0.038

§ 12/16 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台で推移しよう。
共通担保オペは期落ちをロールすると予想する。

12/16 の予定(国内)

金融審議会金融グループを巡る制度の在り方
に関するワーキング・グループ(金融庁)

8:50 預金種類別店頭表示金利の平均年利率等(日銀)

12/16 の予定(海外)

米 FOMCの結果
イェンFRB議長の会見

欧 11月のCPI確報

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	+16,300	2,478,300	+2,478,300	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)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	0.10%	固定金利	-	札割れ
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

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
12/17 ~ 12/24	担保範囲内	1	1	0.820%	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

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