

DAILY SIGNAL

平成27年12月16日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは186兆2000億円だった。
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0.074~0.076%のレンジで出会いが見られ、後場に入ると
0.07~0.075%で調整程度の取引が散見された。

	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,862,000	+1,856,043

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/16 のオペ結果
	12/16(水)		12/17(木)		12/18(金)		12/21(月)		
券		▲2,300		▲4,000		▲4,000		▲3,000	9:20 ノーオペ
財政		▲200		+2,900		+2,000		+65,000	10:10 国債買入(12/18-) (残存1年超3年以下)
過不足		▲2,500		▲1,100		▲2,000		+62,000	+0.002%按分(56.5%) 3,503億 (残存3年超5年以下)
金融調節									+0.008%按分(47.7%) 3,505億 (残存5年超10年以下)
国債買入	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	+0.007%按分(86.3%) 4,009億
国庫短期証券買入		+8,300				+11,000			11:50 国債補完供給(12/16-12/17) ▲0.400%(全取) 125億
国債買現先									12:50 ノーオペ
共通担保(本店)					▲9,200	+2,400	▲1,300		13:00 共通担保(全店)(固定金利) (12/18-2016/3/29) 0.10%(全取)2,350億円
共通担保(全店)									13:50 国債補完供給(12/16-12/17) ▲0.400%(全取) 2億
CP買現先	▲500		▲300						
CP等買入			▲100			+5,500			
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給		▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援	▲11,200	+20,200							
当座預金増減		+14,200	▲1,400		+7,700		+60,700		
当座預金残高		2,476,200	2,474,800		2,482,500		2,543,200		
準備預金残高		2,264,600							
積み終了先		643,800							
超過準備		455,500							
非準備先残高		211,600							
準備預金進捗率		68.8%							
平均		3.2%							
乖離率		65.5%							
			予想込増減	▲1,400	予想込増減	+7,700	予想込増減	+68,700	
			当預見込	2,474,800	当預見込	2,482,500	当預見込	2,551,200	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,040,700
12/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 637,200
12/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 21,200

	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 0.025		
ビッド	0.075 0.010 0.100 0.045		
出来値	- - - -		

12/15 時点のマネタリベース(単位:億円) **3,458,200**

(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
12/16	577(1Y)	-0.0409%	-0.0489%
12/10	576(3M)	-0.0221%	-0.0353%
12/8	575(6M)	-0.0378%	-0.0458%

12/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	214,166	143,899	70,267
	+971	+1,968	-997

*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	0.030	-	-	-	-	0.170	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	-	-	-	0.200	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.076	-	-	-	-	0.185	-	-	-	-
東京レボレート	0.038	0.037	-	0.041	▲0.054	▲0.039	▲0.020	-	0.012	0.027	0.038

§ 12/17 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台で取引されるだろう。
共通担保オペは期落ちをロールすると予想する。

12/17 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(18日まで)

8:50 11月の貿易統計(財務省)

対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

12/17 の予定(海外)

米 7~9月経常収支

週間の新規失業保険申請件数

欧 ECB経済報告

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	▲1,400	2,474,800	+2,474,800	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						
期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	0.10%	固定金利	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	- 札割れ
2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	0.10%	固定金利	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7% 1.24
2015/12/11 ~ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0% 2.70
2015/12/8 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	0.10%	固定金利	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6% 2.46
2015/12/7 ~ 2016/3/7	8,000	450	450	0.10%	固定金利							
2015/11/30 ~ 2016/2/29	8,000	1,310	1,310	0.10%	固定金利							
2015/11/24 ~ 2016/2/22	8,000	2,771	2,771	0.10%	固定金利							
2015/11/16 ~ 2016/2/15	8,000	1,141	1,141	0.10%	固定金利							

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ありません。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