

DAILY SIGNAL

平成27年12月24日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは185兆6000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方0.075%の出合いから始まった。
その後は0.075%近辺で出合いが見られ、後場では0.07~0.075%のレンジで取引された。

また、朝方から試し取りの動きがあり、0.12%台で大きく出合いが見られた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,856,000	+1,856,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/24 のオペ結果
	12/24(木)		12/25(金)		12/28(月)		12/29(火)		
券	▲5,300		▲4,500		▲3,000		▲2,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(12/28-) (残存5年超10年以下) +0.008%按分(32.5%) 4006億 (変動利付債) +0.000円(13.3%) 1,204億 11:50 国債補完供給(12/24-12/25) ▲0.400%(全取) 66億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+2,500		+4,400		▲2,000		▲2,000		
過不足	▲2,800		▲100		▲5,000		▲4,000		
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		+11,200				+5,200			
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)									
CP買現先									
CP等買入	▲1,300		▲1,500						
社債等買入		+1,300	▲200						
ETF買入				+700					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+500	▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+8,800		▲1,000		+200		▲4,000		
当座預金残高	2,536,100		2,535,100		2,535,300		2,531,300		
準備預金残高	2,302,600		2,302,600		2,302,600		2,302,600		
積み終了先	1,841,900		1,841,900		1,841,900		1,841,900		
超過準備	1,841,900		1,841,900		1,841,900		1,841,900		
非準備預金残高	233,500		233,500		233,500		233,500		
準備預金進捗率	98.6%		98.6%		98.6%		98.6%		
平均	29.0%		29.0%		29.0%		29.0%		
乖離率	69.6%		69.6%		69.6%		69.6%		
共通担保(本店)	0		0		0		0		
共通担保(全店)	62,635		62,635		62,635		62,635		
国債買現先	0		0		0		0		
CP買現先	0		0		0		0		
成長基盤強化	58,339		58,339		58,339		58,339		
被災地金融機関支援	3,161		3,161		3,161		3,161		
ロンハート残高	0		0		0		0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,040,700

12/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 28,700

12/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,300

	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	0.090
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.102
出来値	-	-	-	-

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	12/20
長期国債	142	202	283
CP等	2.2	2.2	2.8
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	2.5	3.8	6.7
J-REIT	0.14	0.18	0.27
貸出支援基金	9.2	25	31
国庫短期証券	40	49	45
その他とも資産計	224	300	387
銀行券	90	93	96
当座預金	107	178	248
その他とも負債・純資産計	224	300	387

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
12/24	579(3M)	-0.0144%	-0.0209%
12/17	578(3M)	-0.0111%	-0.0242%
12/16	577(1Y)	-0.0409%	-0.0489%

12/22 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	217,248	+4,394	-
	142,549	-3,376	-
	74,699	+7,770	-

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

12/22 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,541,600

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	0.030	0.073	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.086	0.091	-	-	0.148	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.047	0.091	-	▲0.040	▲0.019	▲0.005	0.008	-	0.015	0.028	0.037

§ 12/25 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%台で取引されるだろう。

共通担保オペはノオベを予想する。

12/25 の予定(国内)

8:30 11月の有効求人倍率(厚労省)

11月全国CPI(総務省)

12月中旬東京都区部CPI(総務省)

12/25 の予定(海外)

米 クリスマスで休日

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオベ	▲1,000	2,535,100	+2,535,100	0.050	0.040	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2015/12/22 ~ 2016/4/1	15,000	1,100	1,100	0.10%	0.10%	-	札割れ	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
2015/12/21 ~ 2016/3/22	8,000	780	780	0.10%	0.10%	-	札割れ	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
2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	0.10%	0.10%	-	札割れ	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	
2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	0.10%	0.10%	-	札割れ	12/24 ~ 1/7	担保範囲内	72	72	0.830%	固定金利	-	1.00	12/17 ~ 12/24	担保範囲内	1	1	0.820%	固定金利	-	1.00
2015/12/11 ~ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	0.10%	0.10%	-	札割れ																
2015/12/8 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	0.10%	0.10%	-	札割れ																
2015/12/7 ~ 2016/3/7	8,000	450	450	0.10%	0.10%	-	札割れ																
2015/11/30 ~ 2016/2/29	8,000	1,310	1,310	0.10%	0.10%	-	札割れ																

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