DAILY SIGNAL

平成27年12月25日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/25 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは185兆9000億円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方0.075%を中心に取引され、
その後はビッドレートが低下し、0.07%台前半での出合となった。
後場に入っても地合いは変わらず水準で推移して引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,859,000	+1,859,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/25 のオペ結果
	12/25(金)		12/28(月)		12/29(火)		12/30(水)		
券	▲4,300		▲3,700		▲2,000		▲1,000		9:20
財政	+4,100		▲3,400		▲2,000		▲5,000		ノーオペ
過不足	▲200		▲7,100		▲4,000		▲6,000		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	国庫短期証券買入(12/29-)
国債買入				+5,200					+0.011%按分(13.5%) 5,000億
国庫短期証券買入						+5,000			10:40
国債買現先									CP等買入(12/30-)
共通担保(本店)									0.048%按分(42.0%) 5,490億
共通担保(全店)									12:50
CP買現先	▲1,500		▲1,100						ノーオペ
CP等買入	▲200								13:00
社債等買入									ノーオペ
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	+100								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲1,100		▲3,000		+1,000		▲500		
当座預金残高	2,535,000		2,532,000		2,533,000		2,532,500		
準備預金残高	2,313,600		2,313,600		2,313,600		2,313,600		
積み終了先	1,853,500		1,853,500		1,853,500		1,853,500		共通担保(本店) 0
超過準備	1,852,400		1,852,400		1,852,400		1,852,400		共通担保(全店) 62,635
非準備先残高	221,400		221,400		221,400		221,400		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		CP買現先 0
平均	38.7%		38.7%		38.7%		38.7%		成長基盤強化 58,339
乖離率	60.9%		60.9%		60.9%		60.9%		被災地金融機関支援 3,143
当座預金増減	▲1,100		▲3,000		+1,000		▲500		ロンハート残高 0
準備預金残高	2,535,000		2,532,000		2,533,000		2,532,500		
準備預金残高	2,313,600		2,313,600		2,313,600		2,313,600		
積み終了先	1,853,500		1,853,500		1,853,500		1,853,500		
超過準備	1,852,400		1,852,400		1,852,400		1,852,400		
非準備先残高	221,400		221,400		221,400		221,400		
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		
平均	38.7%		38.7%		38.7%		38.7%		
乖離率	60.9%		60.9%		60.9%		60.9%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,040,700

12/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,800

12/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.125	-	0.060	0.090
ビッド	0.075	-	0.100	0.102
出来値	-	-	-	-

12/24 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,555,800

(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%

12/24 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	230,686	+13,438	
	144,137	+1,588	
	86,549	+11,850	

*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	0.030	0.071	-	-	-	-	0.155	-	-	-	-
最高	0.121	0.125	-	-	-	-	0.160	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.107	0.125	0.118	0.077	-	0.158	-	-	-	-
東京レボレート	0.058	0.098	-	▲0.035	▲0.011	▲0.002	0.009	-	0.015	0.029	0.037

§ 12/28 オファターのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.07%台で取引されるだろう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

12/28 の予定(国内)

8:50 11月の鉱工業生産速報(経産省)
11月の商業動態統計速報(経産省)

12/28 の予定(海外)

特になし

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								
◎	ノーオペ	▲3,000	2,532,000	+2,532,000	0.050	0.030	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	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
2015/12/22 ~ 2016/4/1	15,000	1,100	1,100	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	2015/12/22 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/12/21 ~ 2016/3/22	8,000	780	780	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	2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	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	2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	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	2015/12/11 ~ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	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	米ドル資金供給オペ					2015/12/8 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	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	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	2015/12/7 ~ 2016/3/7	8,000	450	450	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	12/24 ~ 1/7	担保範囲内	72	72	0.830%	固定金利	-	1.00	2015/11/30 ~ 2016/2/29	8,000	1,310	1,310	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	12/17 ~ 12/24	担保範囲内	1	1	0.820%	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