

# DAILY SIGNAL

平成27年12月29日(火)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 12/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは186兆1000億円だった。  
本日の無担保コールON物は、朝方0.074%の出合から始まり、その後0.073%を中心に取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、0.07%近辺での出合が見られた。後場に入っても水準は変わらず、調整程度の出合が見え引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,861,000	+1,861,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/29 のオペ結果
	12/29(火)		12/30(水)		1/4(月)		1/5(火)		
券	▲3,500		▲300		+7,000		+7,000		9:20
財政	▲4,600		▲8,200		+2,000		▲4,000		ノーオペ
過不足	▲8,100		▲8,500		+9,000		+3,000		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				+11,200					11:50
国庫短期証券買入		+5,000							国債補完供給(12/29-12/30)
国債買現先									▲0.400%(全取) 47億
共通担保(本店)					▲1,500	+1,300			12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先	▲800		▲4,700	+5,500					13:00
CP等買入									共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入									(1/4-4/4)
ETF買入		+200							0.10%(全取) 1,300億円
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									
当座預金増減	▲3,800		+3,600		+8,800		+3,000		
当座預金残高	2,527,400		2,531,000		2,539,800		2,542,800		
準備預金残高	2,308,000								
積み終了先	1,860,700		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,860,600								共通担保(全店) 62,635
非準備先残高	219,400								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	45.2%		予想込増減 +3,600		予想込増減 +8,800		予想込増減 +3,000		成長基盤強化 58,339
乖離率	54.7%		当預見込 2,531,000		当預見込 2,539,800		当預見込 2,542,800		被災地金融機関支援 3,143
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,041,100  
12/30 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 1,400  
12/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	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	0.080
ビッド	0.030	-	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

12/28 時点のマネタリベース(単位:億円) **3,559,000**

(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%

12/28 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	210,337	-8,044	
	137,860	-6,997	
	72,477	-1,047	

\*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	0.050	0.010	-	0.060	-	-	0.180	-	-	-	-
最高	0.080	0.125	-	0.155	-	-	0.200	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.039	-	0.071	0.160	-	0.193	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.050	0.004	-	0.048	0.046	0.046	0.042	-	0.013	0.029	0.037

## § 12/30 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.001~0.03%近辺での取引となろう。  
共通担保オペはノーオペを予想する。

## 12/30 の予定(国内)

19:30 日銀当座預金増減要因と金融調節  
[12月実績速報](日銀)

## 12/30 の予定(海外)

米 11月の中古住宅販売仮契約  
12/31週間の新規失業保険申請件数

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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y								
◎	ノーオペ	+3,600	2,531,000	+531,000	0.001	0.075	0.075	0.075	0.075	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
2016/1/4 ~ 2016/4/4	8,000	1,300	1,300	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	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2015/12/22 ~ 2016/4/1	15,000	1,100	1,100	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	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2015/12/21 ~ 2016/3/22	8,000	780	780	0.10%	固定金利	-	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	按分率	平均レート	按分率	倍率			
2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	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	12/17 ~ 12/24	担保範囲内	1	1	0.820%	固定金利	-	1.00
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																

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