

DAILY SIGNAL

平成27年12月30日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは186兆6000億円だった。
年末初物となる本日の無担保コールON物は、朝方0.004%の出合から始まり、
その後は0.01~0.02%のレンジで取引された。後場にかけて、ビットレートが上昇し、
0.055%近辺での出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,866,000	+1,866,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/30 のオペ結果
	12/30(水)		1/4(月)		1/5(火)		1/6(水)		
券	+0		+6,100		+7,000		+5,000		9:20
財政	▲9,300		+2,100		▲4,000		▲25,000		ノーオペ
過不足	▲9,300		+8,200		+3,000		▲20,000		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	国債買入(1/5-)
国債買入		+11,200				+11,000			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.012%按分(99.0%) 3,501億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)			▲1,500	+1,300					+0.003%按分(40.9%) 3,505億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先	▲4,700	+5,500	▲300						+0.005%按分(20.0%) 4,005億
CP等買入									
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									12:50
国債補完供給	+100								ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノーオペ
当座預金増減	+2,800		+7,700		+14,000		▲20,000		
当座預金残高	2,530,200		2,537,900		2,551,900		2,531,900		
準備預金残高	2,306,500		1,857,500		1,857,500		1,857,500		共通担保(本店)
積み終了先	1,857,500		1,857,500		1,857,500		1,857,500		共通担保(全店)
超過準備	1,857,400		1,857,400		1,857,400		1,857,400		国債買現先
非準備先残高	223,700		223,700		223,700		223,700		CP買現先
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化
平均	61.3%		61.3%		61.3%		61.3%		被災地金融機関支援
乖離率	38.6%		38.6%		38.6%		38.6%		ロンハート残高
			予想込増減	+7,700	予想込増減	+14,000	予想込増減	▲20,000	
			当預見込	2,537,900	当預見込	2,551,900	当預見込	2,531,900	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,042,000
1/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 400
1/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	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	0.085
ビット	0.070	-	0.100	0.102
出来値	-	-	-	-

12/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,558,600

(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%

12/29 のコール市場残高(前日比)			
合計	200,405	-9,932	
有担	130,569	-7,291	
無担	69,836	-2,641	

*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	0.004	0.073	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.079	0.121	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.038	0.099	-	0.155	-	-	0.116	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.025	0.093	-	0.056	0.052	0.050	0.045	-	0.011	0.029	0.037

§ 1/4 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台での取引となろう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

1/4 の予定(国内)

8:50 預金種類別店頭表示金利の
平均年利率等(日銀)

1/4 の予定(海外)

米 2月のISM製造業指数
カンファレンス連銀総裁の講演

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	+7,700	2,537,900	+2,537,900	0.050	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
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	按分レート	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