

DAILY SIGNAL

平成27年1月16日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは133兆5000億円。
新積み期となる本日、無担ON物は朝方0.07%台後半の出合から始まった。
その後も地合いは変わらず、一部0.07%近辺の取引も散見され引けた。
本日入札が実施された国庫短期証券(第507回、1Y)の最高落札利回りは-0.0119%と、
1年物としての過去最低記録を更新した。

(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	-	-	1,335,000	+1,335,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/16 のオペ結果
	1/16(金)		1/19(月)		1/20(火)		1/21(水)		
券	+1,300		+2,200		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲5,400		▲16,700		▲21,000		+2,000		ノオベ
過不足	▲4,100		▲14,500		▲20,000		+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	ノオベ
国債買入				+12,500					12:50
国庫短期証券買入									ノオベ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)			▲1,700	+800					ノオベ
共通担保(全店)									13:50
CP買現先									国債補完供給(1/16-1/19)
CP等買入	▲800		▲200						▲0.400%(全取) 2億
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入		+100		+300					
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	▲4,700		▲2,800		▲20,000		+4,000		
当座預金残高	1,809,300		1,806,500		1,786,500		1,790,500		
準備預金残高	1,642,300								
積み終了先	1,265,500								共通担保(本店) 0
超過準備	763,500								共通担保(全店) 78,040
非準備先残高	167,000								国債買現先 0
準備預金進捗率	86.9%								CP買現先 0
平均	9.7%		予想込増減 ▲2,800		予想込増減 ▲20,000		予想込増減 +4,000		成長基盤強化 44,120
乖離率	77.3%		当預見込 1,806,500		当預見込 1,786,500		当預見込 1,790,500		被災地金融機関支援 3,251
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,978,000
1/19 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 258,500
1/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 9,200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.050	0.080	0.098
ビッド	0.070	0.001	0.095	0.102
出来値	-	-	0.090	-

1/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,755,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	1/10
長期国債	142	202	205
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	3.9
J-REIT	0.14	0.18	0.18
貸出支援基金	9.2	25	25
国庫短期証券	40	49	51
その他とも資産計	224	300	305
銀行券	90	93	90
当座預金	107	178	181
その他とも負債・純資産計	224	300	305

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
1/16	507(1Y)	-0.0119%	-0.0169%
1/15	506(3M)	-0.0020%	-0.0048%
1/9	505(6M)	-0.0061%	-0.0082%

1/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	201,562	-3,346
有担	118,917	-522	
無担	82,645	-2,824	

*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	0.074	-	0.065	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.135	0.125	-	0.260	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.074	0.087	-	0.108	-	-	0.170	-	-	-	-
東京レボレート	0.079	0.098	-	0.062	0.059	0.057	0.055	-	0.036	0.048	0.058

§ 1/19 オファーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.07%台で推移しよう。
共通担保オペのオファーは見送られると予想する。

1/19 の予定(国内)

13:30 11月の鉱工業生産・確報(経産省)
14:00 12月の消費動向調査(内閣府)
14:30 全国百貨店売上高(百貨店協会)

1/19 の予定(海外)

米 休日(キング牧師生誕記念日)
欧 11月の経常収支

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
◎ ノオベ	▲2,800	1,806,500	+1,806,500	0.065	0.070	0.070	0.070	0.075	0.090	0.118	0.125	0.200
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.125	0.125	0.130	0.135	0.140	0.145	0.150	0.170	0.300

共通担保資金供給(全店)					*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
2015/1/19 ~ 2015/4/20	8,000	760	760	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
2015/1/13 ~ 2015/4/13	8,000	910	910	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
2015/1/5 ~ 2015/4/6	8,000	2,400	2,400	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2014/12/22 ~ 2015/3/23	8,000	1,031	1,031	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2014/12/12 ~ 2015/3/24	10,000	3,810	3,810	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2014/12/9 ~ 2015/3/20	10,000	5,655	5,655	0.10%	固定金利	-	札割れ	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
2014/12/8 ~ 2015/3/9	8,000	1,350	1,350	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/15 ~ 1/23	担保範囲内	10	10	0.610%	固定金利	-	1.00
2014/12/1 ~ 2015/3/2	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/8 ~ 1/15	担保範囲内	0	0	0.610%	固定金利	-	応れなし

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