

DAILY SIGNAL

平成28年1月4日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/4 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは187兆3,000億円。
無担保コールON物は朝方0.06%台の出会いから始まり、その後は0.07%近辺で推移した。
後場にかけて0.06%台で散発的に取引され、引けとなった。
ターム物は2~3W物0.11%台後半の出会い。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,873,000	+1,873,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/4 のオペ結果
	1/4(月)		1/5(火)		1/6(水)		1/7(木)		
券	+6,200		+6,200		+5,000		+3,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(1/6-) (残存1年以下) +0.037%全取 700億 (残存10年超25年以下) ▲0.007%按分(19.9%) 2,606億 (残存25年超) +0.002%按分(37.0%) 1,805億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲500		▲5,600		▲25,000		▲24,000		
過不足	+5,700		+600		▲20,000		▲21,000		
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				+11,100		+5,100			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)	▲1,500	+1,300							
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲300						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給									
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+5,200		+11,400		▲14,900		▲21,000		
当座預金残高	2,535,400		2,546,800		2,531,900		2,510,900		
準備預金残高	2,312,000		2,312,000		2,312,000		2,312,000		
積み終了先	1,865,100		1,865,100		1,865,100		1,865,100		
超過準備	1,865,100		1,865,100		1,865,100		1,865,100		
非準備預金残高	223,400		223,400		223,400		223,400		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	64.5%		64.5%		64.5%		64.5%		
乖離率	35.4%		35.4%		35.4%		35.4%		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							62,435		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							58,339		
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) 2,042,000

1/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 300

1/5 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	0.050	0.060	0.070
ビッド	0.070	0.010	0.100	0.085
出来値	-	-	-	-

12/30 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,561,400

(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	回数	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%

12/30 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	193,319	-7,086	
	136,832	+6,263	
	56,487	-13,349	

*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	0.060	-	0.117	0.117	-	0.165	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	0.130	0.310	-	0.630	-	-	-	-
加重平均	0.070	0.079	-	0.121	0.133	0.118	0.191	-	-	-	-
東京レボレート	0.039	0.095	-	0.063	0.057	0.053	0.049	-	0.013	0.029	0.037

§ 1/5 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%近辺で推移しよう。
共通担保オペはノオベを予想する。

1/5 の予定(国内)

8:50 12月のマネタリーベース(日銀)
10:00 12月31日現在の営業毎旬報告(日銀)

1/5 の予定(海外)

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想								
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	+11,400	2,546,800	+2,546,800	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