

DAILY SIGNAL

平成28年1月6日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは186兆8,000億円。
無担ON物は朝方0.075%近辺で取引され、その後も同水準で推移した。
後場に入ってから0.07%前半の出合いが散見され、引けた。
ターム物は3W物0.11台後半の出合い。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,868,000	+1,868,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/6 のオペ結果
	1/6(水)		1/7(木)		1/8(金)		1/12(火)		
券	+4,800		+2,900		+2,000		+4,000		9:20
財政	▲20,500		▲21,400		+5,000		▲12,000		ノーオペ
過不足	▲15,700		▲18,500		+7,000		▲8,000		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(1/8-)
国債買入		+5,600				+12,700			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.016%全取 4,000億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.003%按分(3.0%) 4,212億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.005%按分(76.7%) 4,513億
CP等買入	▲100		▲300				▲600		11:50
社債等買入									国債補完供給(1/6-1/7)
ETF買入									▲0.400%全取 2億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給									ノーオペ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲10,200		▲18,800		+19,700		▲8,600		
当座預金残高	2,538,800		2,520,000		2,539,700		2,531,100		
準備預金残高	2,316,200		2,316,200		2,316,200		2,316,200		
積み終了先	1,871,400		1,871,400		1,871,400		1,871,400		共通担保(本店) 0
超過準備	1,871,400		1,871,400		1,871,400		1,871,400		共通担保(全店) 62,435
非準備預金残高	222,600		222,600		222,600		222,600		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先 0
平均	71.0%		71.0%		71.0%		71.0%		成長基盤強化 58,339
乖離率	28.9%		28.9%		28.9%		28.9%		被災地金融機関支援 3,143
当座預金増減	▲10,200		▲18,800		+19,700		▲8,600		ロンハート残高 0
準備預金残高	2,538,800		2,520,000		2,539,700		2,531,100		
積み終了先	1,871,400		1,871,400		1,871,400		1,871,400		
超過準備	1,871,400		1,871,400		1,871,400		1,871,400		
非準備預金残高	222,600		222,600		222,600		222,600		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	71.0%		71.0%		71.0%		71.0%		
乖離率	28.9%		28.9%		28.9%		28.9%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,042,000

1/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200

1/7 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	0.120	0.050	0.060	0.095
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.102
出来値	-	-	-	-

1/5 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,567,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	12/31
長期国債	142	202	282
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	6.9
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	43
その他とも資産計	224	300	383
銀行券	90	93	98
当座預金	107	178	253
その他とも負債・純資産計	224	300	383

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%

1/5 のコール市場残高(前日比)		
合計	224,640	+25,938
有担	146,096	+9,630
無担	78,544	+16,308

*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	0.070	-	0.098	0.074	0.118	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.121	-	0.155	0.118	0.240	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.086	-	0.116	0.091	0.164	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.046	0.096	-	0.066	0.063	0.059	0.051	-	0.013	0.029	0.037

§ 1/7 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台半ばで推移しよう。
T+2スタートの共通担保オペが実施されると予想する。

1/7 の予定(国内)

1/7 の予定(海外)

米 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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y								
◎	ノーオペ	▲18,800	2,520,000	+2,520,000	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	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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
2015/12/22 ~ 2016/4/1	15,000	1,100	1,100	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
2015/12/21 ~ 2016/3/22	8,000	780	780	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
2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	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
2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/12/11 ~ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2015/12/8 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/7 ~ 1/14	担保範囲内	1	1	0.850%	固定金利	-	1.00
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

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