

DAILY SIGNAL

平成28年1月7日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは185兆8,000億円。
無担ON物は朝方0.074%の出会いから始まり、その後は0.073~0.076%で取引された。後場に入り、一部調整程度の出合いが散見され引けた。
ターム物は2W物が0.11%台後半で取引された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,858,000	+1,858,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/7 のオペ結果
	1/7(木)		1/8(金)		1/12(火)		1/13(水)		
券		+3,000		+1,900		+4,000		+4,000	9:20 ノオベ
財政		▲21,400		+1,300		▲12,000		▲25,000	10:10 ノオベ
過不足		▲18,400		+3,200		▲8,000		▲21,000	10:40 ノオベ
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	10:40 CP等買入(1/13-)
国債買入				+12,900					0.077%按分(43.6%) 2,995億
国庫短期証券買入									11:50 国債補完供給(1/7-1/8)
国債買現先									応札なし
共通担保(本店)					▲600	+800			12:50 ノオベ
共通担保(全店)									13:00 共通担保(全店)(固定金利)
CP買現先									(1/12-4/11)
CP等買入	▲300		▲500						0.10%(全取) 800億円
社債等買入									
ETF買入				+200					
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		▲18,700		+15,800		▲7,800		▲18,000	
当座預金残高		2,520,100		2,535,900		2,528,100		2,510,100	
準備預金残高		2,313,200							
積み終了先		1,866,100							
超過準備		1,866,000							
非準備預金残高		206,900							
準備預金進捗率		99.9%							
平均		74.2%		予想込増減	+15,800	予想込増減	▲7,800	予想込増減	▲18,000
乖離率		25.7%		当預見込	2,535,900	当預見込	2,528,100	当預見込	2,510,100

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,053,000
1/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200
1/8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	0.098
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.101
出来値	-	-	-	-

1/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,552,900

(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
1/7	580(3M)	-0.0162%	-0.0214%
12/24	579(3M)	-0.0144%	-0.0209%
12/17	578(3M)	-0.0111%	-0.0242%

1/6のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
229,758	147,643	82,115
+5,118	+1,547	+3,571

*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	0.072	-	0.117	0.073	-	0.150	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.340	0.340	-	0.155	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.084	-	0.121	0.115	0.118	0.153	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.050	0.099	-	0.066	0.064	0.059	0.054	-	0.014	0.029	0.037

§ 1/8 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台後半で推移しよう。
共通担保オペはノオベを予想する。

1/8 の予定(国内)

8:50 12月の金融政策決定会合における主な意見(日銀)
10:30 11月の毎月労働統計速報(厚労省)
14:00 11月の景気動向指数速報(内閣府)

1/8 の予定(海外)

米 12月の雇用統計
サンフランシスコ連銀総裁の講演
リッチモンド連銀総裁の講演

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	+15,800	2,535,900	+2,535,900	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	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									
2016/1/12 ~ 2016/4/11	8,000	800	800	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 ~ 2016/4/11	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	
2016/1/4 ~ 2016/4/4	8,000	1,300	1,300	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	2015/12/21 ~ 2016/3/22	8,000	780	780	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	
2015/12/22 ~ 2016/4/11	15,000	1,100	1,100	0.10%	固定金利	-	札割れ	2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	0.10%	固定金利	-	札割れ	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	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
2015/12/21 ~ 2016/3/22	8,000	780	780	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	1/7 ~ 1/14	担保範囲内	1	1	0.850%	固定金利	-	1.00	12/24 ~ 1/7	担保範囲内	72	72	0.830%	固定金利	-	1.00	
2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	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																	

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