

DAILY SIGNAL

平成28年1月8日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは188兆4,000億円。
無担ON物は昨日と比べて資金調達需要が強まり、前場0.076~0.078%で取引された。後場に入っても地合いに変化は見られず、0.07%台後半で推移した。ターム物は2W物が半で取引された。本日実施されたTDB(6M、581回)の入札結果は最高利回り▲利回り▲0.0608%となり、前回12月入札分をいずれも下回り過去最低を更新した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,884,000	+1,884,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/8 のオペ結果
	1/8(金)		1/12(火)		1/13(水)		1/14(木)		
券	+2,100		+3,400		+4,000		+3,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(1/13-) (残存5年超10年以下) ▲0.004%按分(8.2%) 4,506億 (残存10年超25年以下) ▲0.002%按分(83.2%) 2,607億 (残存25年超) +0.001%按分(93.8%) 1,807億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+100		▲13,100		▲25,000		▲17,000		
過不足	+2,200		▲9,700		▲21,000		▲14,000		
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		+12,900				+8,900			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)			▲600	+800					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲100			+3,000			
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入		+200		+200					
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	+14,800		▲9,400		▲9,100		▲14,000		
当座預金残高	2,534,900		2,525,500		2,516,400		2,502,400		
準備預金残高	2,328,800		1,886,000		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	1,886,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	1,886,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備預金残高	206,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	99.9%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	87.1%		予想込増減 ▲9,400		予想込増減 ▲9,100		予想込増減 ▲14,000		
乖離率	12.8%		当預見込 2,525,500		当預見込 2,516,400		当預見込 2,502,400		
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) 2,053,000

1/12 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 100

1/12 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	0.101
出来値	-	-	-	-

1/7 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,531,100

(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	回号	最高利回	平均利回
1/8	581(6M)	-0.0425%	-0.0608%
1/7	580(3M)	-0.0162%	-0.0214%
12/24	579(3M)	-0.0144%	-0.0209%

1/7 のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
231,176	142,125	89,051
+1,418	-5,518	+6,936

*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	0.050	0.070	-	0.125	0.118	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	0.150	0.150	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.086	-	0.135	0.131	0.140	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.057	0.100	-	0.067	0.065	0.058	0.054	-	0.014	0.029	0.037

§ 1/12 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%台半ばで取引されよう。
共通担保オペはノオベを予想する。

1/12 の予定(国内)

8:50 11月の国際収支(財務省)
12月の対外対内証券売買(財務省)
15:00 12月の景気ウォッチャー調査(内閣府)

1/12 の予定(海外)

米 オバマ大統領の一般教書演説

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	▲9,400	2,525,500	+2,525,500	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
2016/1/12 ~ 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	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2016/1/4 ~ 2016/4/4	8,000	1,300	1,300	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	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/12/22 ~ 2016/4/1	15,000	1,100	1,100	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	米ドル資金供給オペ							
2015/12/21 ~ 2016/3/22	8,000	780	780	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			
2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	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	2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/12/15 ~ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	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	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							2015/12/8 ~ 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