

DAILY SIGNAL

平成28年1月12日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

S 1/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは188兆1,000億円だった。
本日の無担保コールON物は0.075%の取引から始まり、その後は0.074~0.076%で取引された。一巡後も地合いに変化は見られず、後場にかけて0.072%で調整程度の出合いが見られて引けた。本日実施された国庫短期証券買入オペは按分レート応札倍率2.22倍となった。

	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,881,000	+1,881,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/12 のオペ結果
	1/12(火)		1/13(水)		1/14(木)		1/15(金)		
券	+3,700		+3,400		+3,000		+1,000		9:20 ノオベ
財政	▲12,800		▲24,700		▲17,000		▲10,000		10:10 国庫短期証券買入(1/14-)
過不足	▲9,100		▲21,300		▲14,000		▲9,000		(残存1年以下) 25,000億
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(1/14-)
国債買入				+9,500		+8,900			(残存1年以下) 3,271億
国庫短期証券買入						+25,000			+0.038%按分(33.8%) 4,001億
国債買現先									(残存3年超5年以下) 4,208億
共通担保(本店)	▲600	+800							10:40 米ドル資金供給(1/14-1/22)
共通担保(全店)									利率0.850% 0百万米ドル
CP買現先									12:50 国債補完供給(1/12-1/13)
CP等買入	▲100		▲200	+3,000					▲0.400%(全取) 14億
社債等買入									13:00 ノオベ
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	▲8,800		▲9,000		+19,900		▲9,000		
当座預金残高	2,526,100		2,517,100		2,537,000		2,528,000		
準備預金残高	2,324,400		2,324,400		2,324,400		2,324,400		共通担保(本店) 0
積み終了先	1,880,100		1,880,100		1,880,100		1,880,100		共通担保(全店) 62,635
超過準備	1,880,100		1,880,100		1,880,100		1,880,100		国債買現先 0
非準備預金残高	201,700		201,700		201,700		201,700		CP買現先 0
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		成長基盤強化 58,339
平均	90.3%		90.3%		90.3%		90.3%		被災地金融機関支援 3,143
乖離率	9.7%		9.7%		9.7%		9.7%		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,053,000
1/13 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 0
1/13 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 0

(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%

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.050	0.060	0.055
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.070
出来値	-	-	-	-

1/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,543,900

1/8 のコール市場残高(前日比)			
合計	232,172	+996	
有担	140,362	-1,763	
無担	91,810	+2,759	

*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	-	-	0.114	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	-	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.079	-	0.130	0.132	0.155	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.060	0.100	-	0.064	0.061	0.056	0.052	-	0.015	0.029	0.037

S 1/13 オフアのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台半ばで取引されよう。
共通担保オペは期落ちなく、ノオベを予想する。

1/13 の予定(国内)

8:50 12月のマネーストック(日銀)
1月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

1/13 の予定(海外)

米 12月の財政収支
ページブック

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	▲9,000	2,517,100	+2,517,100	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	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	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	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								
2016/1/4 ~ 2016/4/4	8,000	1,300	1,300	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 ~ 2016/4/1	15,000	1,100	1,100	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	2015/12/11 ~ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/12/22 ~ 2016/4/1	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	2015/12/8 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	0.10%	固定金利	-	札割れ	2015/12/1 ~ 2016/3/22	15,000	10,400	10,400	0.10%	固定金利	-	札割れ								
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	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	倍率	1/14 ~ 1/22	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	-	応札なし	1/7 ~ 1/14	担保範囲内	1	1	0.850%	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