

DAILY SIGNAL

平成28年1月13日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは187兆4,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.075%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、ビッドが薄くなる中、一部調整程度のお合いが見えられた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,874,000	+1,874,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/13 のオペ結果
	1/13(水)		1/14(木)		1/15(金)		1/18(月)		
券	+3,400		+2,100		+1,000		+2,000		9:20
財政	▲25,300		▲11,300		▲10,000		▲5,000		ノオベ
過不足	▲21,900		▲9,200		▲9,000		▲3,000		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	ノオベ
国債買入		+9,500		+8,900					10:40
国庫短期証券買入				+25,000					社債等買入(1/19-)
国債買現先									▲0.03%(全取) 987億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)							▲2,000		ノオベ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200	+3,000	▲200						ノオベ
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入				+300					
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	▲9,600		+24,800		▲9,000		▲5,000		
当座預金残高	2,516,500		2,541,300		2,532,300		2,527,300		
準備預金残高	2,317,400								
積み終了先	1,874,600		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(本店) 0
超過準備	1,874,600								共通担保(全店) 62,635
非準備先残高	199,100								国債買現先 0
準備預金進捗率	100.0%								CP買現先 0
平均	93.5%		予想込増減	+24,800	予想込増減	▲9,000	予想込増減	+3,000	成長基盤強化 58,339
乖離率	6.5%		当預見込	2,541,300	当預見込	2,532,300	当預見込	2,535,300	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

1/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0

1/14 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	0.075
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.085
出来値	-	-	-	-

1/12 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,531,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	1/10
長期国債	142	202	285
CP等	2.2	2.2	2.0
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	386
銀行券	90	93	96
当座預金	107	178	253
その他とも負債・純資産計	224	300	386

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%

1/12 のコール市場残高(前日比)

	合計	230,335	-1,837
有担	137,868	-2,494	
無担	92,467	+657	

*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	-	-	-	-	0.080	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	-	-	-	0.155	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.078	-	0.114	-	0.155	0.132	-	-	-	-
東京レボレート	0.051	0.054	-	0.057	0.057	0.053	0.049	-	0.013	0.029	0.037

§ 1/14 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は引き続き0.075%近辺で取引されよう。
共通担保オペは8,000億円オファーされると予想する。

1/14 の予定(国内)

8:50 11月の機械受注(内閣府)
12月の企業物価指数(日銀)
16:00 12月の投信概況(投信協会)

1/14 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
セントルイス連銀総裁講演
欧 12月3日のECB理事会の議事要旨

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	+24,800	2,541,300	+2,541,300	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	按分率	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート
2016/1/12 ~ 2016/4/11	8,000	800	800	0.10%	固定金利	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%
2016/1/4 ~ 2016/4/4	8,000	1,300	1,300	0.10%	固定金利	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%
2015/12/22 ~ 2016/4/1	15,000	1,100	1,100	0.10%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	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	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	米ドル資金供給オペ						1/14 ~ 1/22	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利
2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	0.10%	固定金利	米ドル資金供給オペ						1/7 ~ 1/14	担保範囲内	1	1	0.850%	固定金利						
2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	0.10%	固定金利	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	米ドル資金供給オペ																	
2015/12/8 ~ 2016/3/18	15,000	13,150	13,150	0.10%	固定金利	米ドル資金供給オペ																	

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