

DAILY SIGNAL

平成28年1月14日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは189兆4,000億円。
無担保コール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。
調達一巡後は0.07%程度で散発的に出合い、引けとなった。
新発10年物国債利回りは一時0.190%をつけ、2015年1月20日以来約1年ぶりに過去最低水準を更新した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,894,000	+1,894,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/14 のオペ結果
	1/14(木)		1/15(金)		1/18(月)		1/19(火)		
券	+2,100		+1,600		+2,000		+2,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(1/18-) (残存1年超3年以下) +0.020%(全取) 4,000億 (残存3年超5年以下) +0.000%按分(74.0%) 4,207億 (残存5年超10年以下) ▲0.005%按分(31.9%) 4,510億 11:50 国債補完供給(1/14-1/15) ▲0.400%(全取) 12億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)\固定金利 (1/18-4/18) 0.10%(全取) 1,340億円
財政	▲12,300		▲10,000		▲5,000		▲4,000		
過不足	▲10,200		▲8,400		▲3,000		▲2,000		
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	+8,900				+12,700				
国庫短期証券買入	+25,000								
共通担保(本店)					▲2,000		+1,300		
共通担保(全店)							▲3,400		
CP買現先			▲800						
CP等買入	▲200								
社債等買入							+1,000		
ETF買入									
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	+23,800		▲8,900		+9,000		▲4,400		
当座預金残高	2,540,300		2,531,400		2,540,400		2,536,000		
準備預金残高	2,338,400								
積み終了先	1,895,500								
超過準備	1,895,500								
非準備先残高	201,900								
準備預金進捗率	100.0%								
平均	96.8%		予想込増減 ▲8,900		予想込増減 +9,000		予想込増減 +10,600		
乖離率	3.2%		当預見込 2,531,400		当預見込 2,540,400		当預見込 2,551,000		
共通担保(本店)			ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +15,000		
共通担保(全店)							0		
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

1/15 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 0

1/15 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	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
1/14	582(3M)	-0.0220%	-0.0276%
1/8	581(6M)	-0.0425%	-0.0608%
1/7	580(3M)	-0.0162%	-0.0214%

	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	0.055
ビッド	0.075	0.010
	0.100	0.075
出来値	-	-
	-	-

1/13 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,518,300

1/13 のコール市場残高(前日比)			
合計	235,476	+5,141	
有担	141,347	+3,479	
無担	94,129	+1,662	

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.080	-	0.130	0.160	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.053	0.094	-	0.060	0.056	0.052	0.050	-	0.013	0.028	0.037

§ 1/15 オペターのオペと市場動向予想

足許金利は0.075%近辺で取引されよう。
T+2スタートの共通担保オペが実施されると予想する。

1/15 の予定(国内)

8:50 マネタリサーベイ(11月)
金融政策決定会合議事録等
(2005年7月~12月開催分)

1/15 の予定(海外)

米 1月のNY連銀製造業景況感指数
NY連銀総裁講演
1月のシカン大消費者信頼感指数

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	当預増減	当預残高	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノオベ	▲8,900	2,531,400	+2,531,400	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	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/1/18 ~ 2016/4/18	8,000	1,340	1,340	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
2016/1/12 ~ 2016/4/11	8,000	800	800	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
2015/12/22 ~ 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
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							
2015/12/18 ~ 2016/3/29	15,000	2,350	2,350	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/14 ~ 1/22	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	-	応札なし
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

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ありません。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