

DAILY SIGNAL

平成28年1月15日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは188兆5,000億円。
無担保コールON物は朝方0.075%の合いから始まり、その後も同程度で推移した。
後場に入ってから0.07%近辺で散発的に取引され、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	1,885,000	+1,885,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/15 のオペ結果
	1/15(金)		1/18(月)		1/19(火)		1/20(水)		
券	+1,700		+2,500		+2,000		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲11,700		+400		▲4,000		▲13,000		10:10 国庫短期証券買入(1/19-)
過不足	▲10,000		+2,900		▲2,000		▲13,000		+0.031%按分(10.6%) 15,000億
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	11:50 国債補完供給 (1/15-1/18) 0億
国債買入				+12,900					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入						+15,000			13:00 共通担保(全店)〈固定金利〉 (1/19-4/28) 0.10%(全取) 6,193億円
国債買現先					▲3,400	+6,200			
共通担保(本店)			▲2,000	+1,300					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲800		▲400						
社債等買入						+1,000			
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	▲10,500		+14,700		+16,800		▲13,000		
当座預金残高	2,529,800		2,544,500		2,561,300		2,548,300		
準備預金残高	2,323,600								
積み終り先	1,879,900								共通担保(本店) 0
超過準備	1,879,900								共通担保(全店) 62,635
非準備先残高	206,200								国債買現先 0
準備預金進捗率	100.0%								CP買現先 0
平均	100.0%		予想込増減 +14,700		予想込増減 +16,800		予想込増減 ▲13,000		成長基盤強化 58,339
乖離率	0.0%		当預見込 2,544,500		当預見込 2,561,300		当預見込 2,548,300		被災地金融機関支援 3,143
									ロンハート残高 0

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,057,100
1/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 289,100
1/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 10,000

	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	0.040
ビッド	0.074	0.010	0.100	0.060
出来値	-	-	-	-

1/14 時点のマネタリベース(単位:億円) **3,540,000**

(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%

1/14 のコール市場残高(前日比)

	合計	233,325	-2,151
有担	142,084	+737	
無担	91,241	-2,888	

*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	-	0.073	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.083	-	0.104	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.049	0.058	-	0.054	0.051	0.050	0.047	-	0.013	0.028	0.037

§ 1/18 オファーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.075%近辺で推移しよう。
共通担保オペのオファーは見送られると予想する。

1/18 の予定(国内)

9:30 黒田日銀総裁挨拶(支店長会議)
14:00 さくらレポート

1/18 の予定(海外)

米 休場(キング牧師誕生日)

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
◎ ノーオペ	+14,700	2,544,500	+2,544,500	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				
2016/1/19 ~ 2016/4/28	15,000	6,193	6,193	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				
2016/1/18 ~ 2016/4/18	8,000	1,340	1,340	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				
2016/1/12 ~ 2016/4/11	8,000	800	800	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				
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	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	1/14 ~ 1/22	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	-	応札なし				
2015/12/15 ~ 2016/3/25	15,000	8,150	8,150	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