

DAILY SIGNAL

平成28年1月21日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/21 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。
本日の無担保コールON物は朝方0.075%の出会いからスタートし、その後は
0.075~0.073%のレンジで取引された。調達一巡後は0.07%程度で散発的に出会い、
引けとなった。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	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				1/21 のオペ結果
	1/21(木)		1/22(金)		1/25(月)		1/26(火)		
債券	▲200		▲900		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲26,700		+300		▲9,000		+7,000		ノオベ
過不足	▲26,900		▲600		▲8,000		+8,000		11:50
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	国債補完供給(1/21-1/22)
国債買入				+12,800					▲0.400%全取 40億
国庫短期証券買入									12:50
国債買現先									ノオベ
共通担保(本店)			▲9,100	+6,100	▲3,300	+3,100			13:00
共通担保(全店)									共通担保(全店)固定金利
CP買現先									(1/25-4/25)
CP等買入	▲100	+3,000	▲300						0.10%(全取) 3131億円
社債等買入									
ETF買入		+200		+100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援				+0		+0			
貸出									
国債補完供給	+200	▲100	+100						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲23,700		+9,100		▲8,200		+8,000		
当座預金残高	2,538,100		2,547,200		2,539,000		2,547,000		
準備預金残高	2,326,900								
積み終了先	1,865,500								共通担保(本店) 0
超過準備	1,862,600								共通担保(全店) 64,795
非準備預金残高	211,200								国債買現先 0
準備預金進捗率	95.5%								CP買現先 0
平均	19.4%		予想込増減 +9,100		予想込増減 ▲8,200		予想込増減 +8,000		成長基盤強化 58,339
乖離率	76.1%		当預見込 2,547,200		当預見込 2,539,000		当預見込 2,547,000		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) 2,057,100
1/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 93,000
1/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 3,700

(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
1/21	584(3M)	-0.0180%	-0.0212%
1/18	583(1Y)	-0.0667%	-0.0727%
1/14	582(3M)	-0.0220%	-0.0276%

	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	0.090
ビッド	0.074	0.010	0.100	0.100
出来値	-	-	-	-

1/20 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	234,645	+45	
	144,565	+994	
	90,080	-949	

1/20 時点のマネタリベース(単位:億円) **3,554,900**

*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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.081	-	0.073	0.073	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.048	0.090	-	0.042	0.042	0.042	0.040	-	0.013	0.028	0.037

§ 1/22 オファのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.075%近辺で取引されよう。
共通担保オペはノオベ予想。

1/22 の予定(国内)

10:00 1月20日現在の営業毎旬報告(日銀)
未定 安倍首相が施政方針など4演説

1/22 の予定(海外)

米 12月中古住宅販売件数
12月景気先行指数

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	+9,100	2,547,200	+2,547,200	0.030	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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/1/25 ~ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	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
2016/1/22 ~ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	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
2016/1/19 ~ 2016/4/28	15,000	6,193	6,193	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
2016/1/18 ~ 2016/4/18	8,000	1,340	1,340	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
2016/1/12 ~ 2016/4/11	8,000	800	800	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/1/4 ~ 2016/4/4	8,000	1,300	1,300	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/12/22 ~ 2016/4/1	15,000	1,100	1,100	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/22 ~ 1/28	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	-	応札なし
2015/12/21 ~ 2016/3/22	8,000	780	780	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

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