

DAILY SIGNAL

平成28年1月22日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは189兆2,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0.075%の出しからスタートし、その後は
0.073~0.076%のレンジで取引された。その後、後場にかけて調整程度の出しが
散見され引けとなった。本日の日経平均株価終値は昨日比+941.27円の1万6,958.53
だった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,892,000	+1,892,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/22 のオペ結果
	1/22(金)		1/25(月)		1/26(火)		1/27(水)		
券	▲1,000		+700		+1,000		+0		9:20
財政	▲400		▲2,400		+7,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲1,400		▲1,700		+8,000		+1,000		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	国庫短期証券買入(1/26-)
国債買入		+12,800				+12,600			▲0.004%按分(83.9%) 25,002億
国庫短期証券買入						+25,000			国債買入(1/26-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)									▲0.006%按分(78.2%) 4,001億
共通担保(全店)	▲9,100	+6,100	▲3,300	+3,100					(残存3年超5年以下)
CP買現先									+0.002%按分(68.6%) 4,205億
CP等買入	▲300		▲800						(残存10年超25年以下)
社債等買入			▲400						+0.000%按分(10.1%) 2,607億
ETF買入									(残存25年超)
J-REIT買入		+100		+100					▲0.015%按分(100%) 1,801億
被災地金融機関支援	+0	+0							11:50
貸出									国債補完供給(1/22-1/25)
国債補完供給	+100								▲0.400%全取 25億
成長基盤強化支援									12:50
貸出増加支援									ノーオペ
									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	+8,300		▲3,000		+45,600		+1,000		
当座預金残高	2,546,400		2,543,400		2,589,000		2,590,000		
準備預金残高	2,332,700		2,332,700		2,332,700		2,332,700		
積み終り先	1,882,400		1,882,400		1,882,400		1,882,400		共通担保(本店) 0
超過準備	1,878,000		1,878,000		1,878,000		1,878,000		共通担保(全店) 61,834
非準備先残高	213,700		213,700		213,700		213,700		国債買現先 0
準備預金進捗率	96.9%		96.9%		96.9%		96.9%		CP買現先 0
平均	29.0%		29.0%		29.0%		29.0%		成長基盤強化 58,339
乖離率	67.9%		67.9%		67.9%		67.9%		被災地金融機関支援 3,144
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,057,100
1/25 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 63,200
1/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,900

	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	0.065
ビッド	0.074	0.010	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

1/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,531,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	1/20
長期国債	142	202	287
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	7.0
J-REIT	0.14	0.18	0.28
貸出支援基金	9.2	25	31
国庫短期証券	40	49	44
その他とも資産計	224	300	390
銀行券	90	93	95
当座預金	107	178	256
その他とも負債・純資産計	224	300	390

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%

1/21 のコール市場残高(前日比)			
	合計	236,967	+2,322
有担	144,710	+145	
無担	92,257	+2,177	

*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	0.073	-	-	0.070	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	0.340	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.082	-	0.130	0.086	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.050	0.098	-	0.039	0.040	0.040	0.040	-	0.013	0.028	0.037

§ 1/25 オファターのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.075%近辺で取引されよう。
共通担保オペはノーオペ予想。

1/25 の予定(国内)

8:50 12月と15年の貿易統計(財務省)
14:00 11月の景気動向指数改定値(内閣府)

1/25 の予定(海外)

なし

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y								
◎	ノーオペ	▲3,000	2,543,400	+2,543,400	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	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	
2016/1/25 ~ 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	1/22 ~ 1/28	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	-	札割れなし	
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	1/14 ~ 1/22	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	-	札割れなし	
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																	
2016/1/4 ~ 2016/4/4	8,000	1,300	1,300	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																	
2015/12/21 ~ 2016/3/22	8,000	780	780	0.10%	固定金利	-	札割れ																	

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