

DAILY SIGNAL

平成28年1月28日(木)

上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/28 オペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは192兆7,000億円。
無担保コールON物は朝方0.075%の出会いからスタート。その後は0.07%台半ばで取引され、後場では0.07%台前半での調整程度の出合いが見られた。
ターム物では、1W物で0.11%台後半の出合いが見られた。

	即日オペ種類	オフー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,927,000	+1,927,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/28 のオペ結果	
	1/28(木)		1/29(金)		2/1(月)		2/2(火)			
債券	▲800		▲200		+2,000		+1,000		9:20	
財政	▲3,800		▲1,700		▲1,000		▲20,000		ノーオペ	
過不足	▲4,600		▲1,900		+1,000		▲19,000		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	ノーオペ	
国債買入				+13,300						
国庫短期証券買入										
国債買現先										
共通担保(本店)					▲500	+400			12:50	
共通担保(全店)									ノーオペ	
CP買現先									13:00	
CP等買入	▲300		▲3,600	+3,500					共通担保(全店)\(固定金利)	
社債等買入	▲100			+300					(2/1-5/2)	
ETF買入		+300							0.10%(全取) 375億円	
J-REIT買入										
被災地金融機関支援貸出										
国債補完供給	+100									
成長基盤強化支援貸出増加支援										
当座預金増減	▲4,600		+11,600		+900		▲19,000			
当座預金残高	2,582,800		2,594,400		2,595,300		2,576,300			
準備預金残高	2,369,500		1,920,800		共通担保オペ当社予想		共通担保(本店)		0	
積み終了先	1,920,800		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)		61,634	
超過準備	1,920,500		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先		0	
非準備先残高	213,300		ノーオペ		ノーオペ		CP買現先		0	
準備預金進捗率	98.3%		ノーオペ		ノーオペ		成長基盤強化		58,339	
平均	41.9%		予想込増減	+11,600	予想込増減	+900	予想込増減	▲19,000	被災地金融機関支援	3,144
乖離率	56.3%		当預見込	2,594,400	当預見込	2,595,300	当預見込	2,576,300	ローンバード残高	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,055,700
 1/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 35,500
 1/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,000

	T/N	T+2		
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オフー	0.120	0.050	0.060	0.065
ビッド	0.050	0.010	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

1/27 時点のマナターベース(単位:億円) **3,581,100**

(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
1/28	585(3M)	-0.0300%	-0.0356%
1/21	584(3M)	-0.0180%	-0.0212%
1/18	583(1Y)	-0.0667%	-0.0727%

1/27 のコール市場残高(前日比)			
合計	有担	無担	
229,687	141,969	87,718	
-1,978	-2,083	+105	

*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	0.050	-	0.096	-	-	0.117	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	0.130	-	-	0.118	-	-	-	-
加重平均	0.074	0.077	-	0.117	0.145	-	0.117	-	-	-	-
東京レポレート	0.047	0.051	-	0.047	0.045	0.042	0.038	-	0.013	0.028	0.037

§ 1/29 オフーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%台で推移しよう。
 共通担保オペはノーオペを予想。

1/29 の予定(国内)

経済・物価情勢の展望[1月の基本的見解](日銀)
 8:30 12月の全国CPI(総務省)
 14:00 基調的なインフレ率を補足するための指標速報(日銀)

1/29 の予定(海外)

米 10~12月のGDP1次速報値
 1月のシカン大消費者信頼感確報
 欧 1月のCPI速報

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	+11,600	2,594,400	+2,594,400	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)

期間	オフー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	倍率
2016/2/1 ~ 2016/5/2	8,000	375	375	0.10%	固定金利	- 札割れ
2016/1/25 ~ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	0.10%	固定金利	- 札割れ
2016/1/22 ~ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	0.10%	固定金利	- 札割れ
2016/1/19 ~ 2016/4/28	15,000	6,193	6,193	0.10%	固定金利	- 札割れ
2016/1/18 ~ 2016/4/18	8,000	1,340	1,340	0.10%	固定金利	- 札割れ
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

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オフー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	倍率
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	- 札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7% 1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0% 2.70
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6% 2.46
米ドル資金供給オペ						
期間	オフー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	倍率
1/28 ~ 2/4	担保範囲内	1	1	0.840%	固定金利	- 1.00
1/22 ~ 1/28	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	- 応れなし

本資料は投資環境等に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