

DAILY SIGNAL

平成28年1月29日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは193兆8,000億円。
無担保コールON物は前場0.07%台前半で取引された。
後場では日銀金融政策決定会合の結果を控えビッドがなくなり、会合の結果が出る
一部で0.01%の出合いが見られた。本日実施の日銀金融政策決定会合
では、「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入が決定された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,938,000	+1,938,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/29 のオペ結果
	1/29(金)		2/1(月)		2/2(火)		2/3(水)		
券	▲200		+1,400		+2,000		+1,000		9:20
財政	▲3,100		▲700		▲1,000		▲20,000		ノーオペ
過不足	▲3,300		+700		+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							12:50
国庫短期証券買入									ノーオペ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)			▲500	+400					ノーオペ
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲3,600	+3,500	▲300						
社債等買入									
ETF買入		+300							
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	+10,200		+300		+1,000		▲19,000		
当座預金残高	2,593,000		2,593,300		2,594,300		2,575,300		
準備預金残高	2,366,300								
積み終了先	1,919,800		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,917,600								共通担保(全店) 61,634
非準備先残高	226,700								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.1%								CP買現先 0
平均	51.6%		予想込増減 +300		予想込増減 +1,000		予想込増減 ▲19,000		成長基盤強化 58,339
乖離率	47.5%		当預見込 2,593,300		当預見込 2,594,300		当預見込 2,575,300		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) 2,051,000
2/1 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 19,000
2/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,300

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.120	-
0.060		▲0.050
ビッド	0.020	-
0.100		0.000
出来値	-	-

1/28 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,577,300

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

1/28 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
223,695 <td></td> <td>143,559</td> <td>-7,582</td>		143,559	-7,582
-5,992 <td></td> <td>+1,590</td> <td></td>		+1,590	
80,136 <td></td> <td></td> <td></td>			

*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	0.010	0.065	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.066	0.079	-	-	-	-	0.145	-	-	-	-
東京レボレート	0.042	0.067	-	0.043	0.043	0.040	0.036	-	0.013	0.028	0.036

§ 2/1 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.01~0.07%のレンジで推移しよう。
共通担保オペはノーオペを予想。

2/1 の予定(国内)

14:00 1月の新車販売(自販連)
15:30 12月末の税収実績(財務省)

2/1 の予定(海外)

米 12月の個人消費支出
12月の建設支出
1月のISM製造業指数

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	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	+300	2,593,300	+2,593,300	0.010	0.030	0.020	0.010	0.010	0.010	0.010	0.010
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				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	オファー額	応札額	落札額	按分率	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	オファー額	応札額	落札額	按分率	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%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	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