

DAILY SIGNAL

平成28年2月3日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは185兆7,000億円。
無担保コールON物は朝方から0.065～0.07%で取引された。
調達一巡後は、ビッドが徐々に薄くなり、
後場に入ると0.05%台での出合も見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,857,000	+1,857,000

(単位:億円)

	日銀速報 2/3(水)		日銀予想 2/4(木)		当社需給予想				2/3 のオペ結果
					2/5(金)		2/8(月)		
券	+900		+500		+0		+1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲53,400		▲17,200		▲2,000		▲2,000		10:10 国債買入(2/5-)
過不足	▲52,500		▲16,700		▲2,000		▲1,000		(残存5年超10年以下)
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	▲0.035%按分(87.6%) 4,506億
国債買入		+9,000				+8,900			(残存10年超25年以下)
国庫短期証券買入		+10,000							▲0.057%按分(96.4%) 2,601億
国債買現先									(残存25年超)
共通担保(本店)									▲0.055%按分(15.4%) 1,802億
共通担保(全店)									11:50
CP買現先									国債補完供給(2/3-2/4)
CP等買入	▲100		▲100						応札なし
社債等買入	▲100			+200					12:50
ETF買入									ノーオペ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									
国債補完供給		+200							
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲33,500		▲16,600		+6,900		▲2,700		
当座預金残高	2,538,300		2,521,700		2,528,600		2,525,900		
準備預金残高	2,298,000								共通担保(本店) 0
積み終了先	1,855,800		ノーオペ		共通担保オペ当社予想				共通担保(全店) 61,484
超過準備	1,855,700				ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		国債買現先 0
非準備先残高	240,300								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.4%								成長基盤強化 58,339
平均	61.3%		予想込増減 ▲16,600		予想込増減 +6,900		予想込増減 +5,300		被災地金融機関支援 3,144
乖離率	38.1%		当預見込 2,521,700		当預見込 2,528,600		当預見込 2,533,900		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,051,000
2/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 12,400
2/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,000

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	-	0.060	0.010
ビッド	0.065	-	0.100	0.035
出来値	-	-	-	-

2/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,563,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	1/31
長期国債	142	202	292
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	7.2
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	46
その他とも資産計	224	300	396
銀行券	90	93	95
当座預金	107	178	259
その他とも負債・純資産計	224	300	396

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%

2/2 のコール市場残高(前日比)

合計	229,304	+10,355
有担	135,443	-4,803
無担	93,861	+15,158

*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	0.030	0.050	0.066	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	0.070	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.064	0.069	0.067	-	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.000	0.024	-	▲ 0.007	▲ 0.055	▲ 0.073	▲ 0.095	-	▲ 0.102	▲ 0.102	▲ 0.102

§ 2/4 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.05～0.07%台のレンジで推移しよう。
共通担保オペはロールオファーを予想する。

2/4 の予定(国内)

8:50 対外対内証券売買契約等の状況(財務省)

2/4 の予定(海外)

米 新規失業保険申請件数

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	▲16,600	2,521,700	+2,521,700	0.010	0.030	0.010	0.010	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)					*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		
2016/2/1 ～ 2016/5/2	8,000	375	375	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		
2016/1/25 ～ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	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		
2016/1/22 ～ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	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		
2016/1/19 ～ 2016/4/28	15,000	6,193	6,193	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		
2016/1/18 ～ 2016/4/18	8,000	1,340	1,340	0.10%	固定金利	-	札割れ			米ドル資金供給オペ									
2016/1/12 ～ 2016/4/11	8,000	800	800	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		
2016/1/4 ～ 2016/4/4	8,000	1,300	1,300	0.10%	固定金利	-	札割れ			2/4 ～ 2/12	担保範囲内	1	1	0.880%	固定金利	-	1.00		
2015/12/22 ～ 2016/4/1	15,000	1,100	1,100	0.10%	固定金利	-	札割れ			1/28 ～ 2/4	担保範囲内	1	1	0.840%	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