

DAILY SIGNAL

平成28年2月9日(火)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 2/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは186兆8,000億円。
無担保コールON物は0.07%の出合から始まり、その後は0.075%中心に取引された。調達一巡後はビッドが徐々に薄くなり、後場にかけて0.06%辺りでの出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,868,000	+1,868,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/9 のオペ結果
	2/9(火)		2/10(水)		2/12(金)		2/15(月)		
券	+200		▲400		+0		+1,000		9:20
財政	+1,600		▲28,800		▲9,000		+56,000		ノーオペ
過不足	+1,800		▲29,200		▲9,000		+57,000		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		+13,000							11:50
国庫短期証券買入		+10,000							国債補完供給(2/9-2/10)
国債買現先									▲0.400%全取 8億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)							▲1,100		ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲100		▲500	+3,500					ノーオペ
社債等買入									
ETF買入									
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	+24,700		▲26,200		▲9,000		+55,900		
当座預金残高	2,547,000		2,520,800		2,511,800		2,567,700		
準備預金残高	2,302,100								共通担保(本店) 0
積み終了先	1,864,500		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) 59,781
超過準備	1,864,000								国債買現先 0
非準備先残高	244,900								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化 58,339
平均	80.6%		予想込増減 ▲26,200		予想込増減 ▲9,000		予想込増減 +63,900		被災地金融機関支援 3,144
乖離率	19.2%		当預見込 2,520,800		当預見込 2,511,800		当預見込 2,575,700		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,060,000
2/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,700
2/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.120	-
0.005	0.075	
ビッド	0.065	-
0.055	0.090	
出来値	-	-

2/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,511,500

(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
2/8	587(6M)	-0.1603%	-0.1743%
2/4	586(3M)	-0.1009%	-0.1308%
1/28	585(3M)	-0.0300%	-0.0356%

2/8 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
2/8	203,517	+5,371	-1,710
116,015	-1,710		
87,502	+7,081		

*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	0.040	0.050	-	0.062	0.150	-	0.110	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	0.120	0.280	-	0.150	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.079	0.120	0.078	0.172	-	0.130	-	-	-	-
東京レボレート	0.009	0.057	-	▲0.046	▲0.088	▲0.106	▲0.115	-	▲0.135	▲0.138	▲0.140

§ 2/10 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.05~0.075%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。

2/10 の予定(国内)

8:50 1月の企業物価指数(日銀)
16:30 1月のフェルの発生状況(日銀)

2/10 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
2/11週間の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	▲26,200	2,520,800	+2,520,800	0.010	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	
				~	~	~	~	~	~	~	~	~	
				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
2016/2/8 ~ 2016/5/9	8,000	0	0	0.10%	固定金利	- 札割れ
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

*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
2/4 ~ 2/12	担保範囲内	1	1	0.880%	固定金利	- 1.00
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