

DAILY SIGNAL

平成28年2月10日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは184兆8,000億円。
無担保コールON物は朝方0.075%の出しからスタート。その後は0.07%台前半で
出しが見られた。後場では調整程度の出しが見られた。

	即日オペ種類	オフー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,848,000	+1,848,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/10 のオペ結果
	2/10(水)		2/12(金)		2/15(月)		2/16(火)		
券	▲400		+0		+1,000		+0		9:20
財政	▲29,900		▲5,400		+56,000		▲5,000		ノーオペ
過不足	▲30,300		▲5,400		+57,000		▲5,000		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	国債買入(2/15-)
国債買入									(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入						+8,900			+0.004%按分(11.1%)4,500億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									▲0.011%按分(34.9%)2,605億
共通担保(全店)					▲1,100	+0			(残存25年超)
CP買現先									▲0.004%按分(38.2%)1,803億
CP等買入	▲500	+3,500	▲800						10:40
社債等買入									米ドル資金供給
ETF買入									(2/12-2/19)
J-REIT買入									貸付金利0.880%0百万米ドル
被災地金融機関支援									12:50
貸出									ノーオペ
国債補完供給									13:00
成長基盤強化支援									共通担保(全店)〈固定金利〉
貸出増加支援									(2/15-5/16)
									応札なし
当座預金増減	▲27,300		▲6,200		+64,800		▲5,000		
当座預金残高	2,519,700		2,513,500		2,578,300		2,573,300		
準備預金残高	2,284,300		1,846,700		1,846,700		1,846,700		共通担保(本店)
積み終了先	1,846,700		1,846,700		1,846,700		1,846,700		共通担保(全店)
超過準備	1,846,700		1,846,700		1,846,700		1,846,700		国債買現先
非準備先残高	235,400		235,400		235,400		235,400		CP買現先
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化
平均	87.1%		87.1%		87.1%		87.1%		被災地金融機関支援
乖離率	12.8%		12.8%		12.8%		12.8%		ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,060,000
2/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,400
2/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフー	0.120	0.005
レボ	0.065	0.055
レボ	0.085	0.102
出来値	-	-

2/9 時点のマナターベース(単位:億円) **3,536,000**

(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
貸出	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
2/10	588(3M)	-0.1102%	-0.1335%
2/8	587(6M)	-0.1603%	-0.1743%
2/4	586(3M)	-0.1009%	-0.1308%

2/9 のコール市場残高(前日比)			
合計	187,971	-	-15,546
有担	104,405	-	-11,610
無担	83,566	-	-3,936

*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	0.015	0.050	0.100	-	-	-	0.001	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	0.122	-	-	-	0.115	-	-	-	-
加重平均	0.072	0.076	0.111	0.030	0.125	-	0.020	-	-	-	-
東京レポレート	0.026	0.085	-	▲0.084	▲0.101	▲0.115	▲0.127	-	▲0.146	▲0.147	▲0.148

§ 2/12 オフ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。
共通担保オペはノーオペを予想する。

2/12 の予定(国内)

8:50 前週の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)
12月のマナターサーベイ(日銀)
12月の貸出先別貸出金利(日銀)

2/12 の予定(海外)

米 1月の小売売上高
欧 10~12月のGDP(速報)
12月の鉱工業生産

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出しレンジ予想									
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	▲6,200	2,513,500	+2,513,500	0.010	▲0.080	▲0.080	▲0.080	▲0.080	▲0.080	▲0.080	▲0.080	▲0.080
					~	~	~	~	~	~	~	~	
					0.125	0.120	0.120	0.120	0.140	0.140	0.140	0.150	0.150

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	オフー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/2/15 ~ 2016/5/16	8,000	0	0	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
2016/2/8 ~ 2016/5/9	8,000	0	0	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
2016/2/1 ~ 2016/5/2	8,000	375	375	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
2016/1/25 ~ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	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
2016/1/22 ~ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/1/19 ~ 2016/4/28	15,000	6,193	6,193	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/1/18 ~ 2016/4/18	8,000	1,340	1,340	0.10%	固定金利	-	札割れ	2/12 ~ 2/19	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	-	応札なし
2016/1/12 ~ 2016/4/11	8,000	800	800	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

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