

DAILY SIGNAL

平成28年2月12日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは183兆8,000億円。
週末となる無担保コールON物は0.075%の出合から始まり、その後も
週末準で推移する堅調な地合いとなった。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%近辺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	-	-	1,838,000	+1,838,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/12 のオペ結果
	2/12(金)		2/15(月)		2/16(火)		2/17(水)		
券	+0		+800		+0		+0		9:20
財政	▲7,700		+47,200		+5,000		▲1,000		ノーオペ
過不足	▲7,700		+48,000		+5,000		▲1,000		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	国庫短期証券買入(2/16-)
国債買入				+9,700					+0.015%按分(57.3%) 17,502億
国庫短期証券買入						+17,500			11:50
国債買現先									国債補完供給(2/12-2/15)
共通担保(本店)			▲1,100	+0					▲0.400%全取 145億
共通担保(全店)									12:50
CP買現先									ノーオペ
CP等買入	▲800		▲600						13:00
社債等買入									ノーオペ
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		▲200		+200					
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲8,700		+56,200		+22,500		▲1,000		
当座預金残高	2,511,000		2,567,200		2,589,700		2,588,700		
準備預金残高	2,273,000								共通担保(本店)
積み終了先	1,835,300								共通担保(全店)
超過準備	1,835,300								国債買現先
非準備先残高	238,000								CP買現先
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化
平均	96.8%		予想込増減 +56,200		予想込増減 +22,500		予想込増減 ▲1,000		被災地金融機関支援
乖離率	3.1%		当預見込 2,567,200		当預見込 2,589,700		当預見込 2,588,700		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,060,000
2/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 600
2/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	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	▲0.050	
ビッド	0.065	-
0.055	0.015	
出来値	-	-

2/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,509,100

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

2/10 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
175,289 <td>-12,682</td> <td>100,929</td> <td>-3,476</td>	-12,682	100,929	-3,476
74,360	-9,206		

*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	0.050	0.001	0.080	-	0.001	0.000	-	-	-	-
最高	0.125	0.121	0.120	0.150	-	0.150	0.150	-	-	-	-
加重平均	0.071	0.075	0.007	0.124	0.001	0.011	0.085	-	-	-	-
東京レポレート	0.022	0.056	-	▲0.099	▲0.106	▲0.116	▲0.125	-	▲0.145	▲0.149	▲0.150

§ 2/15 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.050~0.075%のレンジで推移しよう。
共通担保オペはノーオペを予想。

2/15 の予定(国内)

8:50 10~12月のGDP・1次速報(内閣府)
10:00 2月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

2/15 の予定(海外)

欧 12月の貿易収支
ECB総裁が欧州議会で講演

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	+56,200	2,567,200	+2,567,200	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	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	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	オファー額	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