

DAILY SIGNAL

平成28年2月15日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは187兆4,000億円。
無担保コールON物は0.075%の出合から始まり、その後も同水準で取引された。
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	準備残高	着地残対比
8:00	-	-	1,874,000	+1,874,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/15 のオペ結果
	2/15(月)		2/16(火)		2/17(水)		2/18(木)		
券	+900		+400		+0		▲1,000		9:20
財政	+44,500		▲500		▲1,000		▲12,000		ノーオペ
過不足	+45,400		▲100		▲1,000		▲13,000		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(2/17-)
国債買入		+9,700				+12,700			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+17,500					+0.016%按分(69.6%) 4,011億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)	▲1,100	+0							+0.023%按分(1.9%) 4,202億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									+0.008%按分(87.4%) 4,502億
CP等買入	▲600		▲100						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入				+400					
被災地金融機関支援貸出									13:00
国債補完供給	+200								ノーオペ
成長基盤強化支援貸出増加支援									13:50
									国債補完供給(2/15-2/16)
									▲0.400%全取 1億
当座預金増減	+53,600		+17,700		+11,700		▲13,000		
当座預金残高	2,564,600		2,582,300		2,594,000		2,581,000		
準備預金残高	2,332,700								共通担保(本店)
積み終了先	1,882,100		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
超過準備	1,881,500								国債買現先
非準備先残高	231,900								CP買現先
準備預金進捗率	100.0%								成長基盤強化
平均	100.0%		予想込増減		+17,700		+11,700		被災地金融機関支援
乖離率	0.0%		当預見込		2,582,300		当預見込		2,581,000
									ロンハート残高

来 積み期間の所要準備額(積数) 1,900,000
2/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,900,000
2/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 65,500

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.001	-
0.005	▲0.010	
ビッド	0.000	-
0.055	0.002	
出来値	-	-

2/12 時点のマナタリーベース(単位:億円) **3,500,300**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	2/10
長期国債	142	202	295
CP等	2.2	2.2	2.4
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	45
その他とも資産計	224	300	398
銀行券	90	93	94
当座預金	107	178	252
その他とも負債・純資産計	224	300	398

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%

2/12 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
173,070	-2,219	96,603	-4,326
76,467	+2,107		

*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	0.030	0.050	0.000	0.000	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.040	0.120	0.150	0.280	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.074	0.036	0.085	0.016	0.043	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.014	▲0.019	-	▲0.095	▲0.103	▲0.114	▲0.124	-	▲0.146	▲0.148	▲0.149

§ 2/16 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.000~0.001%を中心に推移しよう。
共通担保オペはノーオペを予想。

2/16 の予定(国内)

13:00 1月の首都圏マンション販売(不動産経済研究所)

2/16 の予定(海外)

米 2月のNY連銀製造業景況感指数
2月のNAHB住宅市場指数

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	+17,700	2,582,300	+2,582,300	▲0.010	▲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)

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
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

*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	按分率	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%	1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46

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	按分率	倍率
2/12 ~ 2/19	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	-	応札なし
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