

DAILY SIGNAL

§ 2/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは190兆9,000億円。
無担保コールON物は0～0.001%の取引が中心であったが、
一部マイナス圏でも取引され、加重平均金利は-0.009%(前日対比-0.007%)となった。
ターム物は1W物ゼロ%近辺の出会いが散見された。

平成28年2月18日(木)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,909,000	+1,909,000

(単位:億円)

	日銀速報 2/18(木)		日銀予想 2/19(金)		当社需給予想				2/18 のオペ結果
	2/18(木)		2/19(金)		2/22(月)		2/23(火)		
券	▲900		▲1,100		+0		▲1,000		9:20
財政	▲10,200		+2,900		▲36,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲11,100		+1,800		▲36,000		+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	ノーオペ
国債買入				+5,700					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(2/18-2/19)
国債買現先									▲0.500%全取 282億
共通担保(本店)									
共通担保(全店)					▲2,800	+2,300			12:50
CP買現先									ノーオペ
CP等買入	▲200		▲600	+3,500					13:00
社債等買入				+800					共通担保(全店)(固定金利)
ETF買入		+100							(2/22-5/23)
J-REIT買入									0%(全取) 2,270億円
被災地金融機関支援									13:50
貸出									国債補完供給(2/18-2/19)
国債補完供給	+300	▲400	+400						▲0.500%全取 120億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲11,300		+11,600		▲36,500		+1,000		
当座預金残高	2,582,400		2,594,000		2,557,500		2,558,500		
準備預金残高	2,355,700								共通担保(本店)
積み終了先	1,850,400								共通担保(全店)
超過準備	1,817,300								0
非準備先残高	226,700								58,640
準備預金進捗率	92.8%						共通担保オベ当社予想		国債買現先
平均	10.3%		予想込増減	+11,600	予想込増減	▲36,500	予想込増減	+1,000	0
乖離率	82.5%		当預見込	2,594,000	当預見込	2,557,500	当預見込	2,558,500	CP買現先
									0
									成長基盤強化
									58,339
									被災地金融機関支援
									3,144
									ロンバート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,900,000
2/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 136,200
2/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 5,200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.000	-	0.001	-0.025
ビッド	-	-	0.030	0.000
出来値	0.000	-	-	-

2/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,582,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	2/10
長期国債	202	282	295
CP等	2.2	2.2	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	7.2
J-REIT	0.18	0.27	0.28
貸出支援基金	25	31	31
国庫短期証券	49	43	45
その他とも資産計	300	383	398
銀行券	93	98	94
当座預金	178	253	252
その他とも負債・純資産計	300	383	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
2/18	590(3M)	-0.1022%	-0.1090%
2/17	589(1Y)	-0.1501%	-0.1601%
2/10	588(3M)	-0.1102%	-0.1335%

2/17 のコール市場残高(前日比)

合計	46,707	+1,347
有担	19,017	+1,441
無担	27,690	-94

*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	0.000	-	-0.001	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.001	-	0.310	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.009	0.000	-	0.008	0.120	-	0.250	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.010	-0.018	-	-0.085	-0.089	-0.102	-0.113	-	-0.150	-0.152	-0.153

§ 2/19 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0%近辺の取引が中心となろう。
共通担保オベのオファーは見送られると予想する。

2/19 の予定(国内)

14:30 1月の全国百貨店売上高(百貨店協会)

2/19 の予定(海外)

米 1月のCPI

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想								
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	+11,600	2,594,000	+2,594,000	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080
				～	～	～	～	～	～	～	～	～
				0.010	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		
2016/2/22 ～ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	0.00%	固定金利	-	札割れ			2015/11/18 ～ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ		
2016/2/15 ～ 2016/5/16	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		
2016/2/8 ～ 2016/5/9	8,000	0	0	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		
2016/2/1 ～ 2016/5/2	8,000	375	375	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		
2016/1/25 ～ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	0.10%	固定金利	-	札割れ			米ドル資金供給オペ									
2016/1/22 ～ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	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		
2016/1/19 ～ 2016/4/28	15,000	6,193	6,193	0.10%	固定金利	-	札割れ			2/19 ～ 2/25	担保範囲内	1	1	0.880%	固定金利	-	1.00		
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	-	応れなし		

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