

DAILY SIGNAL

平成28年2月22日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは188兆1,000億円。
無担保コールON物は一日を通して▲0.01~0.001%のレンジで散発的に取引された。
加重平均金利は前日から0.007%上昇し▲0.001%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,881,000	+1,881,000

(単位:億円)

	日銀速報 2/22(月)		日銀予想 2/23(火)		当社需給予想 2/24(水) 2/25(木)				2/22 のオペ結果
	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	
券		▲100		▲1,200		▲1,000		▲2,000	9:20 ノーオペ
財政		▲41,200		+5,000		+3,000		▲4,000	10:10 ノーオペ
過不足		▲41,300		+3,800		+2,000		▲6,000	10:40 社債等買入(2/26-) ▲0.130%按分(50.0%) 750億
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	11:50 国債補完供給(2/22-2/23) ▲0.500%全取 506億
国債買入				+13,100					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入				+17,600					13:00 ノーオペ
国債買現先									
共通担保(本店)	▲2,800	+2,300							
共通担保(全店)									
CP買現先			▲100						
CP等買入	▲300								
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	+500	▲600	+600						
成長基盤強化支援 貸出増加支援									
当座預金増減		▲42,200		+35,000		+2,000		▲6,000	
当座預金残高		2,550,900		2,585,900		2,587,900		2,581,900	
準備預金残高		2,320,300							共通担保(本店) 0
積み終了先		1,867,200			ノーオペ	ノーオペ		ノーオペ	共通担保(全店) 58,139
超過準備		1,865,400							国債買現先 0
非準備先残高		230,600							CP買現先 0
準備預金進捗率		97.4%							成長基盤強化 58,339
平均		24.1%	予想込増減	+35,000	予想込増減	+2,000	予想込増減	▲6,000	被災地金融機関支援 3,144
乖離率		73.3%	当預見込	2,585,900	当預見込	2,587,900	当預見込	2,581,900	ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,900,000
2/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 48,800
2/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,200

	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 -0.020
ビッド	-	- 0.030 -0.005
出来値	0.000	- - -

2/19 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,584,000

(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%

2/19 のコール市場残高(前日比)

	合計	47,919	-110
有担	16,914	-2,457	
無担	31,005	+2,347	

*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	-0.010	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.010	0.000	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.001	-0.005	-	-0.016	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.010	-0.014	-	-0.085	-0.087	-0.099	-0.112	-	-0.156	-0.165	-0.170

§ 2/23 オペのオペと市場動向予想

足許金利はマイナス圏~0%近辺で推移しよう。
共通担保オペのオファーは見送られると予想する。

2/23 の予定(国内)

10:00 日銀営業毎旬報告(2月20日)
市場調節に関する懇親会(日銀)

2/23 の予定(海外)

米 12月のS&Pケース・ラー住宅価格指数
FRB副議長講演(テキサス州)

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	+35,000	2,585,900	+2,585,900	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

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
2016/2/22 ~ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

*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
2/19 ~ 2/25	担保範囲内	1	1	0.880%	固定金利	- 1.00
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