

# DAILY SIGNAL

平成28年2月23日(火)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 2/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは191兆円。  
無担保コールON物は朝方0~0.001%で取引され、一部マイナスでの取引も見られた。後場に入って0%近辺の出合いが散発的に取引され引けた。  
ターム物は1W物が▲0.02%での出合い。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,910,000	+1,910,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/23 のオペ結果
	2/23(火)		2/24(水)		2/25(木)		2/26(金)		
券	▲1,200		▲1,500		▲2,000		▲2,000		9:20
財政	+4,100		+700		▲4,000		+4,000		ノーオペ
過不足	+2,900		▲800		▲6,000		+2,000		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		+13,100							10:40
国庫短期証券買入		+17,600							米ドル資金供給
国債買現先									(2/25-3/3)
共通担保(本店)									貸付金利0.870% 1百万米ドル
共通担保(全店)									2/25-2/24
CP買現先									▲0.500%全取 501億
CP等買入	▲100		▲300						12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入									13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									13:50
貸出									ノーオペ
国債補完供給	+600	▲800	+800						13:50
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									国債補完供給(2/23-2/24)
									▲0.500%全取 215億
当座預金増減	+33,300		▲300		▲6,000		+2,800		
当座預金残高	2,584,200		2,583,900		2,577,900		2,580,700		
準備預金残高	2,350,100		1,898,000		1,897,700		234,100		
積み終了先	1,898,000		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店)
超過準備	1,897,700		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
非準備預金残高	234,100		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先
準備預金進捗率	97.8%		97.8%		97.8%		97.8%		CP買現先
平均	27.6%		27.6%		27.6%		27.6%		成長基盤強化
乖離率	70.2%		70.2%		70.2%		70.2%		被災地金融機関支援
			予想込増減	▲300	予想込増減	▲6,000	予想込増減	+2,800	ローンハード残高
			当預見込	2,583,900	当預見込	2,577,900	当預見込	2,580,700	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,900,000  
2/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 41,200  
2/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,000

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.000	-
レボG.C	0.001	-0.020
ビット	-	-
出来値	-	-

2/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,541,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	2/20
長期国債	202	282	296
CP等	2.2	2.2	2.5
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	7.4
J-REIT	0.18	0.27	0.29
貸出支援基金	25	31	31
国庫短期証券	49	43	47
その他とも資産計	300	383	401
銀行券	93	98	94
当座預金	178	253	259
その他とも負債・純資産計	300	383	401

## 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%

## 2/22 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	46,923	-991	-
有担	16,975	+61	-
無担	29,953	-1,052	-

\*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	-	-0.010	0.000	-	0.001	-	-	-	-
東京レボレート	-0.011	-0.011	-	-0.081	-0.084	-0.097	-0.107	-	-0.153	-0.165	-0.170

## § 2/24 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は引き続きマイナス圏~0.001%で取引されよう。  
共通担保オペはノーオペを予想する。

## 2/24 の予定(国内)

8:50 1月の企業向けサービス価格(日銀)  
14:00 12月の景気動向指数改訂値(内閣府)

## 2/24 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数  
セントルイス連銀総裁講演

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	▲300	2,583,900	+2,583,900	-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
2/25 ~ 3/3	担保範囲内	1	1	0.870%	固定金利	- 1.00
2/19 ~ 2/25	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