

DAILY SIGNAL

平成28年2月24日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは190兆6000億円。
無担保コールON物は朝方▲0.01~0%で取引され、一部0.001%の取引も散見された。
後場に入って0%近辺の出会いが散発的に見られ引けた。
本日実施されたCP等買入オペの按分レートは▲0.298%となり、過去最低を更新した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,906,000	+1,906,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/24 のオペ結果
	2/24(水)		2/25(木)		2/26(金)		2/29(月)		
券	▲1,600		▲2,300		▲2,000		▲1,000		10:10
財政	▲400		▲1,100		+4,000		+7,000		国債買入(2/26-)
過不足	▲2,000		▲3,400		+2,000		+6,000		(残存1年超3年以下)
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	+0.001%按分(12.6%) 4,001億
国債買入									(残存3年超5年以下)
国庫短期証券買入						+12,600			+0.001%按分(38.6%) 4,202億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)									▲0.002%按分(80.5%) 2,602億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先									▲0.011%按分(26.3%) 1,801億
CP等買入	▲300		▲900						10:40
社債等買入			▲600						CP買入(2/29-)
ETF買入				+300					▲0.298%按分(35.0%) 4,000億
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援									▲0.500%全取 473億
貸出									12:50
国債補完供給	+800	▲600	+600						ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノーオペ
									13:50
当座預金増減	▲2,100		▲4,000		+15,400		+8,700		国債補完供給(2/24-2/25)
当座預金残高	2,582,100		2,578,100		2,593,500		2,602,200		▲0.500%全取 45億
準備預金残高	2,351,700		2,351,700		2,351,700		2,351,700		
積み終了先	1,896,800		1,896,800		1,896,800		1,896,800		共通担保(本店)
超過準備	1,896,500		1,896,500		1,896,500		1,896,500		共通担保(全店)
非準備先残高	230,400		230,400		230,400		230,400		国債買現先
準備預金進捗率	98.3%		98.3%		98.3%		98.3%		CP買現先
平均	31.0%		31.0%		31.0%		31.0%		成長基盤強化
乖離率	67.3%		67.3%		67.3%		67.3%		被災地金融機関支援
									ロンハート残高
									0
									0
									58,139
									0
									0
									58,339
									3,144
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,900,000
2/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 32,200
2/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,600

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.000	-0.030
ビッド	-	-0.010
出来値	0.000	-

2/23 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,576,300

(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%

2/23 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	49,139	+2,211	-2,217
	16,758	-	-
	32,381	+2,428	-

*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	-0.050	-0.010	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	-	0.280	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.003	-0.005	-	0.001	0.007	-	0.001	-	-	-	-
東京レボレート	-0.010	-0.011	-	-0.075	-0.074	-0.087	-0.101	-	-0.150	-0.165	-0.170

§ 2/25 オペのオペと市場動向予想

足許金利はマイナス圏~0.001%で取引されるだろう。
共通担保オペは8000億円オファーされると予想する。

2/25 の予定(国内)

8:50 前週の対外対内証券売買(財務省)
未定 2月の月例経済報告(内閣府)

2/25 の予定(海外)

米 1月の耐久財受注
週間の新規失業保険申請件数

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	▲4,000	2,578,100	+2,578,100	-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	

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				
2016/2/22 ~ 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	按分率	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	2/25 ~ 3/3	担保範囲内	1	1	0.870%	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	2/19 ~ 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