

DAILY SIGNAL

平成29年2月2日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは243兆1000億円だった。
無担保コールON物は朝方▲0.035%の合出から始まり、その後は▲0.08～▲0.03%のレンジで取引された。調達一巡後も地合に変化はなく、後場に入って調整程度の合出が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,431,000	+2,431,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/2 のオペ結果
	2/2(木)		2/3(金)		2/6(月)		2/7(火)		
券	+100		+100		+1,000		+1,000		9:20
財政	▲71,600		+5,900		▲25,000		▲3,000		ノーオペ
過不足	▲71,500		+6,000		▲24,000		▲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				+11,700					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(2/2-2/3)
国債買現先									▲0.600%全取 2,086億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲1,600	+1,600			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入			▲100						共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入		▲100							(2/6-2/20)
ETF買入				+100					0%全取 1,590億
J-REIT買入									13:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(2/2-2/3)
貸出									▲0.600%全取 31億
国債補完供給	+1,500	▲2,100	+2,100						
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲72,200		+19,800		▲24,000		▲2,000		
当座預金残高	3,240,000		3,259,800		3,235,800		3,233,800		
準備預金残高	2,896,800								
積み終了先	2,430,400								共通担保オペ当社予想
超過準備	2,430,400								ノーオペ
非準備先残高	343,200								ノーオペ
準備預金進捗率	99.8%								ノーオペ
平均	58.1%		予想込増減 +19,800		予想込増減 ▲24,000		予想込増減 ▲2,000		共通担保(全店) 3,341
乖離率	41.7%		当預見込 3,259,800		当預見込 3,235,800		当預見込 3,233,800		国債買現先 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,227,300
2/3以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,900
2/3以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.035	-	-0.100	-0.095
ビッド	-0.080	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

2/1 時点のマナターベース(単位:億円) 4,348,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	1/31
長期国債	282	361	368
CP等	2.2	2.3	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	11.8
J-REIT	0.27	0.36	0.36
貸出支援基金	31	41	41
国庫短期証券	43	50	47
その他とも資産計	383	476	482
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	332
その他とも負債・純資産計	383	476	482

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
2/2	661(3M)	-0.2625%	-0.2709%
1/26	660(3M)	-0.2525%	-0.2733%
1/19	659(3M)	-0.2805%	-0.2861%

2/1 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	102,939	+10,066	
有担	20,194	+737	
無担	82,745	+9,329	

*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	-0.085	-	-	-	-	-0.020	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	0.002	-	-	-	-	-
加重平均	-0.052	0.000	-	-0.030	0.010	-0.015	0.000	-	-	-	-
東京レボレート	-0.102	-0.103	-	-0.110	-0.111	-0.112	-0.120	-	-0.153	-0.225	-0.228

§ 2/3 オファターのオペと市場動向予想

足許は▲0.085～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

2/3 の予定(国内)

8:50 16年12月19～20日の金融政策会合議事要旨
(日銀)

2/3 の予定(海外)

米 1月の雇用統計
米 1月のISM非製造業指数

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	+19,800	3,259,800	+3,259,800	-0.085	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.010	-0.010	-0.020	-0.030
				~	~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.001	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
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/1/23 ~ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/1/16 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	0.00%	固定金利	- 札割れ
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	0.00%	固定金利	- 札割れ

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
2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	- 札割れ
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

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
2/2 ~ 2/9	担保範囲内	0	0	1.160%	固定金利	0.0% 応札なし
1/26 ~ 2/2	担保範囲内	122	122	1.160%	固定金利	0.0% 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