

DAILY SIGNAL

平成29年2月8日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは248兆4000億円だった。
無担保コールON物は朝方▲0.025%の出合から始まった。昨日に引き続き
ビッドサイドが優勢で、▲0.040~0%と、やや高めレンジで取引された。
後場に入っても地合に変化は見られず、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,484,000	2,484,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/8のオペ結果
	2/8(水)		2/9(木)		2/10(金)		2/13(月)		
券	+700		+100		+0		+1,000		9:20
財政	+1,700		▲8,700		▲15,000		▲19,000		ノーオペ
過不足	+2,400		▲8,600		▲15,000		▲18,000		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	国債買入(2/10-)
国債買入		+7,500				+13,000			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.001% 按分(99.1%) 4,002億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.002% 按分(70.2%) 4,204億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.004% 按分(81.6%) 4,510億
CP等買入	▲100		▲300	+3,000					(物価連動債)
社債等買入									▲0.110% 按分(100%) 251億
ETF買入									
J-REIT買入		+200		+400					10:40
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									11:50
国債補完供給	+200								国債補完供給(2/8-2/9)
米ドル供給用担保国債供給									▲0.500% 全取 25億
成長基盤強化支援									12:50
貸出増加支援									ノーオペ
当座預金増減	+10,200		▲5,500		▲2,000		▲19,500		13:00
当座預金残高	3,265,900		3,260,400		3,258,400		3,238,900		ノーオペ
準備預金残高	2,946,500		2,946,500		2,946,500		2,946,500		共通担保オペア当社予想
積み終了先	2,487,400		2,487,400		2,487,400		2,487,400		共通担保(全店) +8,000
超過準備	2,487,400		2,487,400		2,487,400		2,487,400		共通担保(全店) 3,360
非準備先残高	319,400		319,400		319,400		319,400		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先 0
平均	77.4%		77.4%		77.4%		77.4%		成長基盤強化 76,205
乖離率	22.5%		22.5%		22.5%		22.5%		被災地金融機関支援 5,251
			予想込増減 ▲5,500	予想込増減 ▲2,000	予想込増減 ▲11,500				ロンバート残高 0
			当預見込 3,260,400	当預見込 3,258,400	当預見込 3,246,900				

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,246,500
2/9以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,800
2/9以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.020	-
レボ	-	-0.100
レボ	-	-0.095
ビッド	-0.050	-
レボ	-	0.000
レボ	-	-0.085
出来値	-	-

2/7 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,288,900

(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	回号	最高利回	平均利回
2/8	662 (6M)	-0.1853%	-0.2235%
2/2	661 (3M)	-0.2625%	-0.2709%
1/26	660 (3M)	-0.2525%	-0.2733%

2/7のコール市場残高(前日比)			
合計	96,251	-	-858
有担	20,870	-	+212
無担	75,381	-	-1,070

*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	-0.070	-	-	-0.025	-	-0.025	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	-	0.002	-	-	-	-	-
加重平均	-0.028	0.001	-	-0.023	0.000	-0.018	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.096	-0.090	-	-0.101	-0.107	-0.113	-0.117	-	-0.153	-0.225	-0.228

§ 2/9 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.05~+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペアは期落ち分がロールオファーされると予想。

2/9の予定(国内)

8:50 12月の機械受注(内閣府)
10:30 日銀・中曽副総裁講演(高知市)

2/9の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
シカゴ連銀総裁講演

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	▲5,500	3,260,400	+3,260,400	-0.050	-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)					*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				
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	-	札割れ	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ				
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	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				
2017/1/23 ~ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	0.00%	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				
2017/1/16 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	0.00%	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				
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	0.00%	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				
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	札割れ	2/9 ~ 2/16	担保範囲内	1	1	1.160%	固定金利	0.0%	1.00				
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	0.00%	固定金利	-	札割れ	2/2 ~ 2/9	担保範囲内	0	0	1.160%	固定金利	0.0%	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