

DAILY SIGNAL

平成29年2月9日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは248兆2000億円だった。
無担保コールオン物は朝方▲0.025%の出合から始まり、その後は▲0.03~▲0.02%のレンジを中心に取引された。前営業日に引き続き調達意欲は強く、一部0%での出合いも見られた。後場に入っても地合は変わらず、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	-	-	2,482,000	2,482,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/9 のオペ結果
	2/9(木)		2/10(金)		2/13(月)		2/14(火)		
券		+200		+0		+1,000		+1,000	9:20
財政		▲9,600		▲15,300		▲19,000		+4,000	ノーオペ
過不足		▲9,400		▲15,300		▲18,000		+5,000	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
国債買入先									ノーオペ
国債買入先									11:50
共通担保(本店)					▲1,500	+1,400			国債補完供給(2/9-2/10)
共通担保(全店)									▲0.500% 全取 2,369億
CP買入先									12:50
CP等買入	▲300	+3,000	▲200						ノーオペ
社債等買入									13:00
ETF買入		+400		+600					共通担保(全店)(固定金利)
J-REIT買入									(2/13-2/27)
被災地金融機関支援									0% 全取 1,430億
貸出									13:50
国債補完供給		▲2,400	+2,400						国債補完供給(2/9-2/10)
米ドル供給用担保国債供給									▲0.500% 全取 8億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減		▲8,700	+600		▲18,100		+5,000		
当座預金残高		3,257,200	3,257,800		3,239,700		3,244,700		
準備預金残高		2,933,700							
積み終了先		2,476,600							共通担保オベ当社予想
超過準備		2,476,600							ノーオペ
非準備先残高		323,500							ノーオペ
準備預金進捗率		99.9%							共通担保(全店)
平均		80.6%	予想込増減	+600	予想込増減	▲18,100	予想込増減	+5,000	国債買入先
乖離率		19.3%	当預見込	3,257,800	当預見込	3,239,700	当預見込	3,244,700	CP買入先
									成長基盤強化
									被災地金融機関支援
									ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,246,500
2/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,300
2/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.020	-	-0.100	-0.090
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.075
出来値	-	-	-	-

2/8 時点のマナターベース(単位:億円) 4,298,300

(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
2/9	663 (3M)	-0.1904%	-0.2128%
2/8	662 (6M)	-0.1853%	-0.2235%
2/2	661 (3M)	-0.2625%	-0.2709%

2/8 のコール市場残高(前日比)		
合計	98,079	+1,828
有担	20,613	-257
無担	77,466	+2,085

*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	-0.065	-	-	-0.015	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.035	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.027	0.000	-	0.002	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.095	-0.089	-	-0.103	-0.108	-0.113	-0.117	-	-0.153	-0.211	-0.223

§ 2/10 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。
共通担保オベはノーオペを予想する。

2/10 の予定(国内)

8:50 1月の企業物価指数(日銀)
13:30 12月の第3次産業活動(経産省)

2/10 の予定(海外)

米 日米首脳会談
2月のシカン大消費者信頼感速報

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	+600	3,257,800	+3,257,800	-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
2017/2/13 ~ 2017/2/27	8,000	1,430	1,430	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
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	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
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	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
2017/1/23 ~ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	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 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ							
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	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
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	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
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	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