

DAILY SIGNAL

平成29年2月13日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは246兆8000億円だった。
無担保コールON物は朝方▲0.02%の出合から始まり、その後は▲0.045～▲0.015%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.07～▲0.06%台の出合も見られた。同加重平均金利は先週末対比▲0.004%となる▲0.027%だった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,468,000	2,468,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/13 のオペ結果
	2/13(月)		2/14(火)		2/15(水)		2/16(木)		
券	+600		+100		+0		▲1,000		9:20
財政	▲21,000		+900		+56,000		▲26,000		ノーオペ
過不足	▲20,400		+1,000		+56,000		▲27,000		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				+11,900					11:50
国庫短期証券買入				+15,000					国債補完供給(2/13-2/14)
国債買現先									▲0.500%全取 5,357億
共通担保(本店)	▲1,500	+1,400							12:50
共通担保(全店)			▲300						ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200								ノーオペ
社債等買入									
ETF買入		+700		+600					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+3,700	▲5,400	+5,400						
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	▲21,700		+33,600		+56,000		▲27,000		
当座預金残高	3,233,800		3,267,400		3,323,400		3,296,400		
準備預金残高	2,926,900								
積み終了先	2,470,000								
超過準備	2,469,900								共通担保(全店) 3,330
非準備先残高	306,900								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	93.5%		予想込増減 +33,600		予想込増減 +56,000		予想込増減 ▲27,000		成長基盤強化 76,205
乖離率	6.4%		当預見込 3,267,400		当預見込 3,323,400		当預見込 3,296,400		被災地金融機関支援 5,251
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,246,500
2/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
2/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.015	-0.100
レボG.C	-0.075	-0.075
ビッド	-0.030	0.000
レボG.C	-0.060	-0.060
出来値	-	-

2/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,287,600

(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%

2/10 のコール市場残高(前日比)

	合計	101,916	+5
有担	19,816	-337	
無担	82,100	+342	

*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	-0.080	-	-	-0.015	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.005	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.027	0.000	-	-0.008	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.087	-0.076	-	-0.100	-0.105	-0.112	-0.115	-	-0.151	-0.208	-0.219

§ 2/14 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.07～+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。

2/14 の予定(国内)

8:50 日銀営業毎旬報告

2/14 の予定(海外)

米 イレブンFRB議長が半期の金融政策報告 (米上院)

ダラス連銀総裁講演

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	+33,600	3,267,400	+3,267,400	-0.070	-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

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	米ドル資金供給オペ							
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