

DAILY SIGNAL

平成29年2月15日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは251兆8000億円だった。
積み最終日となる本日の無担保コールON物は朝方▲0.02%の落ちから始まり、
その後は▲0.04～▲0.015%のレンジで取引された。
調達一巡後も出合の水準は変わらず、後場にかけても出合が見られた。
また、一部で試し取りの動きが見られ、+0.001%での取引が散見された。

	即日オペ種類	オファ額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	2,518,000	2,518,000

(単位:億円)

	日銀速報 2/15(水)		日銀予想 2/16(木)		当社需給予想				2/15 のオペ結果
	エンド	スタート	エンド	スタート	2/17(金)		2/20(月)		
債券	▲500		▲700		▲1,000		+0		9:20
財政	+57,300		▲28,900		▲3,000		▲25,000		ノオベ
過不足	+56,800		▲29,600		▲4,000		▲25,000		10:10
金融調節									国債買入(2/17-)
国債買入									(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									▲0.012% 按分(3.9%) 4,003億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.004% 按分(78.7%) 4,203億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									0.000% 按分(60.2%) 4,501億
CP等買入	▲1,300		▲200						11:50
社債等買入									国債補完供給(2/15-2/16)
ETF買入									▲0.500% 全取 7,492億
J-REIT買入		+400		+400					
被災地金融機関支援									12:50
貸出									ノオベ
国債補完供給	+10,100	▲7,600	+7,600						13:00
米ドル供給用担保国債供給									ノオベ
成長基盤強化支援									13:50
貸出増加支援									国債補完供給(2/15-2/16)
									▲0.500% 全取 50億
当座預金増減	+58,400		▲21,800		+11,700		▲26,600		
当座預金残高	3,315,100		3,293,300		3,305,000		3,278,400		
準備預金残高	2,973,500								
積み終了先	2,500,700								共通担保オベ当社予想
超過準備	2,500,700								共通担保(全店) +8,000
非準備先残高	341,600								共通担保(全店) 3,330
準備預金進捗率	100.0%								国債買現先 0
平均	100.0%								CP買現先 0
乖離率	0.0%								成長基盤強化 76,205
									被災地金融機関支援 5,251
									ロンバート残高 0

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,016,100
2/16以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 2,016,100
2/16以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 72,000

	T/N	T+2
無担 ユーロ円 CP現先 レボG.C	-	-
オファ	-0.015	-0.095
ビッド	-0.035	-0.090
出来値	-	-

2/14 時点のマナリーベース(単位:億円) 4,288,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	2/10
長期国債	282	361	373
CP等	2.2	2.3	2.5
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	12.0
J-REIT	0.27	0.36	0.37
貸出支援基金	31	41	41
国庫短期証券	43	50	46
その他とも資産計	383	476	485
銀行券	98	102	98
当座預金	253	330	326
その他とも負債・純資産計	383	476	485

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
2/15	664 (1Y)	-0.2513%	-0.2613%
2/9	663 (3M)	-0.1904%	-0.2128%
2/8	662 (6M)	-0.1853%	-0.2235%

2/14 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	97,806	20,154	77,652
	+3,986	+1,737	+2,249

*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	-	-	-0.023	-0.032	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.020	0.005	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.026	-	-	-0.013	-0.015	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.079	-0.085	-	-0.096	-0.104	-0.110	-0.114	-	-0.149	-0.208	-0.219

§ 2/16 オファのオペと市場動向予想

足許は▲0.08～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オベは期落ち分がロールオファされると予想。

2/16 の予定(国内)

17.0 業態別の日銀当座預金残高(1月)

2/16 の予定(海外)

米 住宅着工件数(1月)
週間新規失業保険申請件数

即日オペ金額	翌営業日の即日オペ予想			翌営業日の出合いレンジ予想									
	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎ ノーオベ	▲21,800	3,293,300	+3,293,300	-0.080	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.010	-0.010	-0.010	-0.010	
				~	~	~	~	~	~	~	~	~	
				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)						共通担保資金供給(本店)					
期間	オファ額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	期間	オファ額	応札額	落札額	按分レート	平均レート
2017/2/13 ~ 2017/2/27	8,000	1,430	1,430	0.00%	固定金利	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	0.00%	固定金利	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%
2017/1/23 ~ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	0.00%	固定金利	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%
2017/1/16 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	0.00%	固定金利	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	期間	オファ額	応札額	落札額	按分レート	平均レート
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	0.00%	固定金利	2/16 ~ 2/24	担保範囲内	7	7	1.160%	固定金利
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	2/9 ~ 2/16	担保範囲内	1	1	1.160%	固定金利

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(登名)第243号 加入協会 日本証券業協会