

DAILY SIGNAL

平成29年2月16日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは249兆1000億円だった。
積み初日となる本日の無担保コールON物は朝方▲0.02%の出合から始まり、
その後は▲0.07~▲0.02%の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。
また、引き続き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。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,491,000	2,491,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/16 のオペ結果
	2/16(木)		2/17(金)		2/20(月)		2/21(火)		
券	▲700		▲1,000		+0		+0		9:20
財政	▲30,400		+400		▲25,000		+4,000		ノーオペ
過不足	▲31,100		▲600		▲25,000		+4,000		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				+12,800					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(2/16-2/17)
国債買現先									▲0.500% 全取 265億
共通担保(本店)					▲1,600	+1,500			12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲200	+3,000					共通担保(全店)<固定金利>
社債等買入									(2/20-3/6)
ETF買入		+400							0% 全取 1,516億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+7,600	▲300	+300						
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	▲23,600		+15,300		▲25,100		+4,000		
当座預金残高	3,291,500		3,306,800		3,281,700		3,285,700		
準備預金残高	2,967,800								
積み終了先	2,139,300								共通担保オペ当社予想
超過準備	801,900								共通担保(全店) 3,330
非準備先残高	323,700								国債買現先 0
準備預金進捗率	84.0%								CP買現先 0
平均	3.6%		予想込増減 +15,300		予想込増減 ▲25,100		予想込増減 +4,000		成長基盤強化 76,205
乖離率	80.4%		当預見込 3,306,800		当預見込 3,281,700		当預見込 3,285,700		被災地金融機関支援 5,251
									ロンハート残高 #VALUE!

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,016,100
2/17 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 322,600
2/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 11,900

	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	-0.080
出来値	-	-	-	-

2/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,346,900

(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
2/16	665 (3M)	-0.2024%	-0.2156%
2/15	664 (1Y)	-0.2513%	-0.2613%
2/9	663 (3M)	-0.1904%	-0.2128%

2/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	97,950	19,339	78,611
	+144	-815	+959

*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	-	-	-0.075	-0.020	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.010	0.010	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.045	-	-	-0.045	-0.010	0.010	0.001	-	-	-	-
東京レボレート	-0.088	-0.088	-	-0.098	-0.105	-0.109	-0.114	-	-0.149	-0.208	-0.219

§ 2/17 オファー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。
共通担保オペはノーオペを予想する。

2/17 の予定(国内)

14:30 16年の家計調査(総務省)

2/17 の予定(海外)

米 1月景気先行指数

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	+15,300	3,306,800	+3,306,800	-0.080	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-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)				*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
2017/2/20 ~ 2017/3/6	8,000	1,516	1,516	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
2017/2/13 ~ 2017/2/27	8,000	1,430	1,430	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
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	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
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	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
2017/1/23 ~ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2017/1/16 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	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
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	0.00%	固定金利	-	札割れ	2/16 ~ 2/24	担保範囲内	7	7	1.160%	固定金利	0.0%	1.00
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

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