

DAILY SIGNAL

平成29年2月20日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは247兆7000億円だった。
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▲0.075～▲0.02%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、そのまま引けた。
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。

(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	-	-	2,477,000	2,477,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/20 のオペ結果
	2/20(月)		2/21(火)		2/22(水)		2/23(木)		
券	▲400		▲400		▲1,000		▲2,000		9:20
財政	▲31,000		+4,500		+3,000		▲5,000		ノーオペ
過不足	▲31,400		+4,100		+2,000		▲7,000		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				+4,500					11:50
国庫短期証券買入				+10,000					国債補完供給(2/20-2/21)
国債買現先									▲0.500% 全取 200億
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			▲200						13:00
CP等買入	▲300								ノーオペ
社債等買入									13:50
ETF買入		+200		+100				+800	国債補完供給(2/20-2/21)
J-REIT買入									▲0.500% 全取 63億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+200	▲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	▲31,700		+18,800		+2,000		▲6,200		
当座預金残高	3,275,200		3,294,000		3,296,000		3,289,800		
準備預金残高	2,947,500								
積み終了先	2,465,100								共通担保オペ当社予想
超過準備	2,464,400								ノーオペ
非準備先残高	327,700								ノーオペ
準備預金進捗率	99.1%								ノーオペ
平均	17.9%		予想込増減 +18,800		予想込増減 +2,000		予想込増減 ▲6,200		共通担保(全店) 3,256
乖離率	81.3%		当預見込 3,294,000		当預見込 3,296,000		当預見込 3,289,800		国債買現先 0
									CP買現先 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

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,016.100
2/21 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 17,200
2/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 800

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-	-0.100
レボ	-0.045	0.000
ビッド	-	-0.080
出来値	-	-

2/17 時点のマナタリーベース(単位:億円) 4,340,600

(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%

2/17 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	94,665	20,054	74,611
	+2,516	-113	+2,629

*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	-0.100	-	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.007	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.046	-	-	-	-0.016	0.000	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.087	-0.084	-	-0.106	-0.108	-0.110	-0.115	-	-0.149	-0.204	-0.219

§ 2/21 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。

2/21 の予定(国内)

13:30 12月の全産業活動指数(経産省)
14:00 1月のスーパー売上高(日本CS協会)
14:30 1月の全国百貨店売上高(百貨店協会)

2/21 の予定(海外)

米 フィラデルフィア連銀総裁講演
ユーロ圏 EU財務相理事会(ブリュッセル)
2月の製造業PMI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	+18,800	3,294,000	+3,294,000	-0.100	-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