

DAILY SIGNAL

平成29年2月28日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは248兆円だった。
無担保コールON物は朝方▲0.025%の出合から始まった。
その後は▲0.075～▲0.04%で出合が見られ、一部では
▲0.025～▲0.015%での出合も散見された。
後場では▲0.08%の出合が見られ、引けた。

(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	-	-	2,480,000	2,480,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/28 のオペ結果
	2/28(火)		3/1(水)		3/2(木)		3/3(金)		
券	▲700		▲600		+0		▲1,000		9:20
財政	+8,000		▲11,100		▲65,000		▲4,000		ノーオペ
過不足	+7,300		▲11,700		▲65,000		▲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		+8,500		+9,000					10:40
国庫短期証券買入		+5,000							米ドル資金供給(3/2-3/9)
国債買現先									貸付利率 1.160% 1百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(2/28-3/1)
CP買現先									▲0.500% 全取 1,596億
CP等買入	▲3,400	+3,000	▲500						12:50
社債等買入	▲100								ノーオペ
ETF買入		+200		+1,200					13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									13:50
貸出									国債補完供給(2/28-3/1)
国債補完供給	+100	▲2,300	+2,300						▲0.500% 全取 645億
米ドル供給用担保国債供給							▲800	+5,700	
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+18,300		+300		▲65,000		▲100		
当座預金残高	3,296,700		3,297,000		3,232,000		3,231,900		
準備預金残高	2,937,700		2,474,200		共通担保オペ当社予想		共通担保オペ当社予想		
積み終了先	2,474,200		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 3,196
超過準備	2,474,100								国債買現先 0
非準備先残高	359,000								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化 76,205
平均	46.4%		予想込増減 +300		予想込増減 ▲65,000		予想込増減 ▲100		被災地金融機関支援 5,251
乖離率	53.5%		当預見込 3,297,000		当預見込 3,232,000		当預見込 3,231,900		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,016.600
3/1 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 2,100
3/1 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 100

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.010	-	-0.100	-0.100
ビッド	-0.045	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

2/27 時点のマナターベース(単位:億円) 4,318,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	2/20
長期国債	282	361	374
CP等	2.2	2.3	2.6
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	12.2
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	43
その他とも資産計	383	476	484
銀行券	98	102	99
当座預金	253	330	327
その他とも負債・純資産計	383	476	484

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
2/23	666(3M)	-0.2505%	-0.2593%
2/16	665(3M)	-0.2024%	-0.2156%
2/15	664(1Y)	-0.2513%	-0.2613%

2/27 のコール市場残高(前日比)

	合計	95,568	-5,173
有担	20,341	-378	
無担	75,227	-4,795	

*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	-	-	-0.012	-0.010	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.002	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	-0.010	-	-0.005	-0.005	0.005	-0.050	-	-	-	-
東京レボレート	-0.099	-0.091	-	-0.105	-0.106	-0.113	-0.144	-	-0.145	-0.201	-0.218

§ 3/1 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。

3/1 の予定(国内)

日銀佐藤審議委員挨拶(徳島)
16:00 債券市場サバイ(日銀)

3/1 の予定(海外)

米 ベンジャック
週間MBA住宅ローン申請指数
ダウ連銀総裁の講演

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	+300	3,297,000	+3,297,000	-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				
2017/2/27 ~ 2017/3/13	8,000	1,370	1,370	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				
2017/2/20 ~ 2017/3/6	8,000	1,516	1,516	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				
2017/2/13 ~ 2017/2/27	8,000	1,430	1,430	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				
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	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				
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2017/1/23 ~ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	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 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	0.00%	固定金利	-	札割れ	3/2 ~ 3/9	担保範囲内	1	1	1.160%	固定金利	0.0%	1.00				
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	0.00%	固定金利	-	札割れ	2/24 ~ 3/2	担保範囲内	202	202	1.140%	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