

DAILY SIGNAL

平成28年2月19日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/19 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは191兆3,000億円。
無担保コールON物は0%近辺で推移し、マイナス圏の取引も相応に見られた。
加重平均金利は前日から0.001%上昇し▲0.008%となった。
ターム物は1W物0.01%の出し合い。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,913,000	+1,913,000

(単位:億円)

	日銀速報 2/19(金)		日銀予想 2/22(月)		当社需給予想				2/19 のオペ結果
	2/23(火)	2/24(水)							
券	▲1,100		+300		▲1,000		▲1,000		9:20
財政	+2,500		▲41,600		+2,000		+3,000		ノーオペ
過不足	+1,400		▲41,300		+1,000		+2,000		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	国庫短期証券買入(2/23-)
国債買入		+5,700				+12,700			+0.020%按分(20.4%) 17,502億
国庫短期証券買入						+17,500			国債買入(2/23-)
国債買現先									(1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲2,800	+2,300					▲0.036%按分(45.3%) 4,001億
共通担保(全店)									(3年超5年以下)
CP買現先									▲0.015%按分(34.7%) 4,205億
CP等買入	▲600	+3,500	▲300						(5年超10年以下)
社債等買入									▲0.023%按分(65.6%) 4,504億
ETF買入		+800							11:50
J-REIT買入									国債補完供給(2/19-2/22)
被災地金融機関支援									▲0.500%全取 447億
貸出									12:50
国債補完供給	+400	▲500	+500						ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノーオペ
									13:50
									ノーオペ
当座預金増減	+10,700		▲41,600		+31,200		+2,000		
当座預金残高	2,593,100		2,551,500		2,582,700		2,584,700		
準備預金残高	2,355,200		1,897,300		共通担保オペ当社予想		共通担保(本店)		0
積み終了先	1,897,300		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)		58,640
超過準備	1,884,000		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先		0
非準備先残高	237,900		ノーオペ		ノーオペ		CP買現先		0
準備預金進捗率	97.0%		97.0%		97.0%		成長基盤強化		58,339
平均	20.7%		予想込増減 ▲41,600		予想込増減 +31,200		予想込増減 +2,000		被災地金融機関支援
乖離率	76.3%		当預見込 2,551,500		当預見込 2,582,700		当預見込 2,584,700		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,900,000
2/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 57,800
2/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,500

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.000	-
0.001	-	-0.045
ビッド	-	-
0.030	-	-0.025
出来値	0.000	-

2/18 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,572,100**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	2/10
長期国債	202	282	295
CP等	2.2	2.2	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	7.2
J-REIT	0.18	0.27	0.28
貸出支援基金	25	31	31
国庫短期証券	49	43	45
その他とも資産計	300	383	398
銀行券	93	98	94
当座預金	178	253	252
その他とも負債・純資産計	300	383	398

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
2/18	590(3M)	-0.1022%	-0.1090%
2/17	589(1Y)	-0.1501%	-0.1601%
2/10	588(3M)	-0.1102%	-0.1335%

2/18 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
2/18	48,029	+1,322	-
2/17	19,371	+354	-
2/16	28,658	+968	-

*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	-0.040	-0.005	-	-0.010	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.300	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.008	-0.003	-	0.006	0.010	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.012	-0.008	-	-0.086	-0.090	-0.101	-0.115	-	-0.155	-0.157	-0.160

§ 2/22 オファーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利はマイナス圏~0%近辺で推移しよう。
共通担保オペのオファーは見送られると予想する。

2/22 の予定(国内)

9:00 1月の公社債投資家別売買状況(日証協)

2/22 の予定(海外)

米 2月の製造業PMI
欧 2月のユーロ圏製造業PMI
2月のユーロ圏サービス業PMI

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出し合いレンジ予想								
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	▲41,600	2,551,500	+2,551,500	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				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
2016/2/22 ~ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	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
2016/2/15 ~ 2016/5/16	8,000	0	0	0.10%	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
2016/2/8 ~ 2016/5/9	8,000	0	0	0.10%	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
2016/2/1 ~ 2016/5/2	8,000	375	375	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2016/1/25 ~ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/1/22 ~ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	0.10%	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
2016/1/19 ~ 2016/4/28	15,000	6,193	6,193	0.10%	固定金利	-	札割れ	2/19 ~ 2/25	担保範囲内	1	1	0.880%	固定金利	-	1.00
2016/1/18 ~ 2016/4/18	8,000	1,340	1,340	0.10%	固定金利	-	札割れ	2/12 ~ 2/19	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	-	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