

DAILY SIGNAL

平成29年2月17日(金)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは251兆円だった。
無担保コールON物は朝方▲0.03%の出合から始まり、
その後は▲0.075～▲0.025%のレンジで取引された。
調達一巡後も地合は変わらず、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,510,000	2,510,000

(単位: 億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/17 のオペ結果
	2/17(金)		2/20(月)		2/21(火)		2/22(水)		
券	▲1,100		▲400		+0		▲1,000		9:20
財政	+800		▲30,600		+4,000		+3,000		ノーオペ
過不足	▲300		▲31,000		+4,000		+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(2/21-)
国債買入		+12,800				+4,200			▲0.001%按分(88.2%) 10,000億
国庫短期証券買入						+10,000			国債買入(2/21-)
国債買現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)			▲1,600	+1,500					▲0.006%按分(38.5%) 2,004億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先									▲0.003%按分(21.6%) 1,201億
CP等買入	▲200	+3,000	▲300						(変動利付債)
社債等買入									▲0.200円按分(51.7%) 1,003億
ETF買入				+200					10:40
J-REIT買入									社債等買入(2/23-)
被災地金融機関支援									▲0.100%按分(90.0%) 750億
貸出									11:50
国債補完供給	+300	▲200	+200						国債補完供給(2/17-2/20)
米ドル供給用担保国債供給									▲0.500% 全取 229億
成長基盤強化支援									12:50
貸出増加支援									ノーオペ
									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	+15,400		▲31,000		+18,200		+2,000		
当座預金残高	3,306,900		3,275,900		3,294,100		3,296,100		
準備預金残高	2,978,500								共通担保オペ当社予想
積み終了先	2,493,700		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 3,330
超過準備	2,408,600								国債買現先 0
非準備先残高	328,400								CP買現先 0
準備預金進捗率	98.6%								成長基盤強化 76,205
平均	14.3%		予想込増減 ▲31,000		予想込増減 +18,200		予想込増減 +2,000		被災地金融機関支援 5,251
乖離率	84.3%		当預見込 3,275,900		当預見込 3,294,100		当預見込 3,296,100		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,016.100
2/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 28,800
2/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,200

	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	-0.045	-	0.000	-0.080
出来値	-	-	-	-

2/16 時点のマネタリーベース(単位: 億円) 4,324,100

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

2/16 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	92,149	+829	-6,629

*出所: 営業毎旬報告

*貸出支援基金には米ドル特分含む。

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	-	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-0.010	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.047	-	-	-0.020	-0.016	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.086	-0.082	-	-0.097	-0.106	-0.110	-0.116	-	-0.149	-0.207	-0.219

§ 2/20 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。

2/20 の予定(国内)

8:50 貿易統計(1月)
9:00 公社債投資家別売買状況(1月)

2/20 の予定(海外)

ユーロ圏 消費者信頼感(2月)

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	▲31,000	3,275,900	+3,275,900	-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)				*当日物			
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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
2017/2/13 ~ 2017/2/27	8,000	1,430	1,430	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/2/6 ~ 2017/2/20	8,000	1,590	1,590	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/1/30 ~ 2017/2/13	8,000	1,460	1,460	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/1/23 ~ 2017/2/6	8,000	1,571	1,571	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/1/16 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	0.00%	固定金利	-	札割れ
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	0.00%	固定金利	-	札割れ

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	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70

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。 上田八木証券株式会社 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