

DAILY SIGNAL

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

§ 2/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは190兆円だった。
無担保コールON物は朝方▲0.01~0%で取引され、一部0.001%の取引も散見された。
後場に入り▲0.01~0%での取引が見られて引けた。
ターム物は1W物で▲0.005%の出会いが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,900,000	+1,900,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/29 のオペ結果
	2/29(月)		3/1(火)		3/2(水)		3/3(木)		
券	▲200		+0		+1,000		+0		9:20
財政	+3,600		▲7,200		▲50,000		▲1,000		ノーオペ
過不足	+3,400		▲7,200		▲49,000		▲1,000		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	国債買入(3/2-)
国債買入				+6,000		+12,600			(1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+7,500					▲0.009%按分(33.3%) 4,003億
国債買現先									(3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.011%按分(17.3%) 4,202億
共通担保(全店)	▲1,300	+700							(10年超25年以下)
CP買現先									▲0.012%按分(6.7%) 2,601億
CP等買入	▲3,100	+4,000	▲300						(25年超)
社債等買入			▲100						0.000%按分(0.6%) 1,800億
ETF買入		+300							
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給									ノーオペ
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+4,000		+5,900		▲36,400		▲1,000		
当座預金残高	2,589,900		2,595,800		2,559,400		2,558,400		
準備預金残高	2,346,000		1,901,500		共通担保オペ当社予想		共通担保オペ当社予想		共通担保(本店)
積み終了先	1,901,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
超過準備	1,900,800								国債買現先
非準備先残高	243,900								CP買現先
準備預金進捗率	99.8%								成長基盤強化
平均	48.3%		予想込増減 +5,900		予想込増減 ▲36,400		予想込増減 ▲1,000		被災地金融機関支援
乖離率	51.5%		当預見込 2,595,800		当預見込 2,559,400		当預見込 2,558,400		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,917.300
3/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4.100
3/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.001	-
レボ	-	0.001
レボ	-	-0.020
レボ	-	0.005
レボ	-	0.000
出来値	-	-

2/26 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,583,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	2/20
長期国債	202	282	296
CP等	2.2	2.2	2.5
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	7.4
J-REIT	0.18	0.27	0.29
貸出支援基金	25	31	31
国庫短期証券	49	43	47
その他とも資産計	300	383	401
銀行券	93	98	94
当座預金	178	253	259
その他とも負債・純資産計	300	383	401

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
2/25	591(3M)	-0.1002%	-0.1066%
2/18	590(3M)	-0.1022%	-0.1090%
2/17	589(1Y)	-0.1501%	-0.1601%

2/26 のコール市場残高(前日比)

	合計	48,004	+2,897
有担	16,254	-322	
無担	31,750	+3,219	

*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	-0.010	-0.005	-	-	-0.005	-	-	-	-	-	-
最高	0.010	0.000	-	-	0.280	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.001	-0.004	-	-	0.043	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.010	-0.005	-	-0.022	-0.026	-0.053	-0.097	-	-0.130	-0.159	-0.169

§ 3/1 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は、▲0.01~+0.001%
で取引されるだろう。共通担保オペはノーオペ予想。

3/1 の予定(国内)

8:30 1月の有効求人倍率(厚労省)
1月の完全失業率(総務省)

3/1 の予定(海外)

2月ISM製造業指数
米大統領選予備選

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想								
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	+5,900	2,595,800	+2,595,800	-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
2016/2/29 ~ 2016/5/30	8,000	740	740	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
2016/2/22 ~ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	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
2016/2/15 ~ 2016/5/16	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
2016/2/8 ~ 2016/5/9	8,000	0	0	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
2016/2/1 ~ 2016/5/2	8,000	375	375	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/1/25 ~ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	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
2016/1/22 ~ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	0.10%	固定金利	-	札割れ	2/25 ~ 3/3	担保範囲内	1	1	0.870%	固定金利	-	1.00
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

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