

DAILY SIGNAL

平成27年1月7日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは132兆6000億円だった。
本日の無担ON物は朝方0.07%の出会いから始まり、その後出会いの中心は0.07~0.075%となった。一巡後も同水準で取引され、後場には0.07%で調整程度の出会いが散見され引けた。ターム物は1W-1M物で0.11%台後半で取引された。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,326,000	+1,326,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/7 のオペ結果	
	1/7(水)		1/8(木)		1/9(金)		1/13(火)			
券		+5,800		+3,500		+3,000		+4,000	9:20 ノーオペ	
財政		▲19,100		▲33,100		+3,000		▲10,000		10:10
過不足		▲13,300		▲29,600		+6,000		▲6,000	国庫短期証券買入(1/9-)	
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	+0.014%按分(26.5%) 25,001億	
国債買入		+5,000				+12,000			国債買入(1/9-)	
国庫短期証券買入						+25,000			(残存1年超3年以下)	
国債買現先									+0.011%(全取) 4,000億	
共通担保(本店)									(残存3年超5年以下)	
共通担保(全店)									+0.003%(70.5%) 4001億	
CP買現先									(残存5年超10年以下)	
CP等買入	▲100		▲100						▲0.002%(13.6%) 4,011億	
社債等買入										
ETF買入										
J-REIT買入				+100						
被災地金融機関支援貸出										
国債補完供給									13:50	
成長基盤強化支援貸出増加支援									国債補完供給(1/7-1/8)	
									▲0.400%(全取) 1億	
当座預金増減		▲8,400		▲29,600		+43,000		▲7,500		
当座預金残高		1,799,200		1,769,600		1,812,600		1,805,100		
準備預金残高		1,640,500	共通担保オペ当社予想							
積み終了先		1,330,300	ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)		+8,000	共通担保(本店) 0
超過準備		1,330,300								共通担保(全店) 78,671
非準備先残高		158,700								国債買現先 0
準備預金進捗率		99.7%								CP買現先 0
平均		74.2%	予想込増減	▲29,600	予想込増減	+43,000	予想込増減	+500		成長基盤強化 44,120
乖離率		25.5%	当預見込	1,769,600	当預見込	1,812,600	当預見込	1,813,100		被災地金融機関支援 3,251
										ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,965,100
1/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,400
1/8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
オフア	0.120	0.050	0.075	0.100
ビッド	0.072	0.010	0.100	0.105
出来値	-	-	0.093	-

1/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,769,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	12/31
長期国債	142	202	202
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	3.8
J-REIT	0.14	0.18	0.18
貸出支援基金	9.2	25	25
国庫短期証券	40	49	49
その他とも資産計	224	300	300
銀行券	90	93	93
当座預金	107	178	178
その他とも負債・純資産計	224	300	300

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
1/6	503(3M)	0.0000%	0.0000%
12/18	502(3M)	-0.0018%	-0.0063%
12/17	501(1Y)	-0.0040%	-0.0050%

1/6 のコール市場残高(前日比)			
合計	200,066	+14,782	
有担	120,780	+5,423	
無担	79,286	+9,359	

*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	0.055	0.070	-	0.093	0.115	0.140	0.080	-	-	-	-
最高	0.135	0.120	-	0.117	0.340	0.300	0.225	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.092	0.079	0.115	0.129	0.208	0.135	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.072	0.100	-	0.058	0.053	0.052	0.052	-	0.039	0.049	0.058

§ 1/8 オフアのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07-0.075%を中心に取引されよう。
共通担保オペは期落ちのロールを行うだろう。

1/8 の予定(国内)

8:50 対外及び対内証券売買契約等の状況
(財務省)

1/8 の予定(海外)

米 新規失業保険申請件数
ミアアボリス連銀総裁の講演

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	▲29,600	1,769,600	+1,769,600	0.065	0.070	0.070	0.070	0.075	0.090	0.118	0.125	0.200								
				~	~	~	~	~	~	~	~	~								
				0.125	0.125	0.130	0.135	0.140	0.145	0.150	0.170	0.300								

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	オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間		オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間		オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率														
2015/1/5 ~ 2015/4/6	8,000	2,400	2,400	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	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2014/12/22 ~ 2015/3/23	8,000	1,031	1,031	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ										期間		オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率													
2014/12/12 ~ 2015/3/24	10,000	3,810	3,810	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/8 ~ 1/15		担保範囲内		0	0	0.610%	固定金利	-	札割れなし	12/29 ~ 1/8		担保範囲内		1,528	1,528	0.630%	固定金利	-	1.00												
2014/12/9 ~ 2015/3/20	10,000	5,655	5,655	0.10%	固定金利	-	札割れ																																
2014/12/8 ~ 2015/3/9	8,000	1,350	1,350	0.10%	固定金利	-	札割れ																																
2014/12/1 ~ 2015/3/2	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ																																
2014/11/25 ~ 2015/2/23	8,000	2,650	2,650	0.10%	固定金利	-	札割れ																																
2014/11/17 ~ 2015/2/16	8,000	3,370	3,370	0.10%	固定金利	-	札割れ																																

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