

DAILY SIGNAL

平成27年1月8日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは130兆8000億円だった。
本日の無担ON物は朝方0.07%の出会いから始まり、その後は
0.07~0.076%で推移した。一巡後もビッドは残り、堅調な地合いとなった。
後場にかけて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	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,308,000	+1,308,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/8 のオペ結果
	1/8(木)		1/9(金)		1/13(火)		1/14(水)		
券	+3,600		+2,000		+4,000		+3,000		9:20 ノオペ 11:50 国債補完供給(11/8-11/9) ▲0.400%全取 1億 12:50 ノオペ 13:00 共通担保オペ(全店)(固定金利方式) (1/13-4/13) 0.10%(全取) 910億
財政	▲33,500		+3,100		▲10,000		▲25,000		
過不足	▲29,900		+5,100		▲6,000		▲22,000		
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				+12,200					
国庫短期証券買入				+25,000					
国債買現先									
共通担保(本店)					▲1,500	+900			
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲600						
社債等買入									
ETF買入		+100		+100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲29,900		+41,800		▲6,600		▲22,000		
当座預金残高	1,769,300		1,811,100		1,804,500		1,782,500		
準備預金残高	1,615,800								共通担保(本店) 0
積み終了先	1,305,300		ノオペ		ノオペ		ノオペ		共通担保(全店) 78,671
超過準備	1,305,300								国債買現先 0
非準備先残高	153,500								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.7%								成長基盤強化 44,120
平均	77.4%		予想込増減 +41,800		予想込増減 ▲6,600		予想込増減 ▲22,000		被災地金融機関支援 3,251
乖離率	22.3%		当預見込 1,811,100		当預見込 1,804,500		当預見込 1,782,500		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,977,100
1/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 5,500
1/9 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
オファー	0.120	0.050	0.080	0.100
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.105

(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

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
1/8	504(3M)	0.0000%	-0.0044%
1/6	503(3M)	0.0000%	0.0000%
12/18	502(3M)	-0.0018%	-0.0063%

1/7 のコール市場残高(前日比)

合計	201,704	+1,638
----	---------	--------