

DAILY SIGNAL

平成27年1月23日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは132兆2000億円。
本日の無担ON物は朝方0.072%の出会いから始まり、
その後は、0.07%台前半～0.075%のレンジで取引された。
後場にかけてはヒッドがうすくなり、0.07%近辺での出会いとなった。

	即日オペ種類	オフアー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,322,000	+1,322,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/23 のオペ結果
	1/23(金)		1/26(月)		1/27(火)		1/28(水)		
券	▲800		+1,100		+1,000		+1,000		9:20
財政	+3,100		▲19,700		+5,000		▲2,000		ノーオペ
過不足	+2,300		▲18,600		+6,000		▲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	国庫短期証券買入(1/27-)
国債買入									+0.023%(全取) 30,000億
国庫短期証券買入						+11,800			国債買入(1/27-)
国債買現先						+30,000			(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲4,100	+2,900					+0.016% (全取) 4,000億
共通担保(全店)									(残存3年超5年以下)
CP買現先									▲0.029%按分(45.5%) 4,002億
CP等買入	▲500	+3,500	▲1,000						(残存10年超25年以下)
社債等買入	▲200								▲0.092%按分(12.7%) 2,401億
ETF買入		+300		+300					(残存25年超)
J-REIT買入									▲0.047%按分(94.9%) 1,402億
被災地金融機関支援									11:50
貸出									国債補完供給(1/23-1/26)
国債補完供給		▲100	+100						▲0.400%(全取) 62億
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	+5,300		▲20,400		+47,800		▲1,000		
当座預金残高	1,803,100		1,782,700		1,830,500		1,829,500		
準備預金残高	1,629,900		1,316,600		1,316,600		1,316,600		
積み終了先	1,316,600		1,316,600		1,316,600		1,316,600		共通担保(本店) 0
超過準備	1,312,800		1,312,800		1,312,800		1,312,800		共通担保(全店) 77,139
非準備預金残高	173,200		173,200		173,200		173,200		国債買現先 0
準備預金進捗率	96.7%		96.7%		96.7%		96.7%		CP買現先 0
平均	32.3%		32.3%		32.3%		32.3%		成長基盤強化 44,120
乖離率	64.4%		64.4%		64.4%		64.4%		被災地金融機関支援 3,252
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,978,000
1/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 65,800
1/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 3,100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフアー	0.120	0.050	0.085	0.080
ヒッド	0.070	0.010	0.098	0.090
出来値	-	-	0.095	-

1/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,734,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	1/20
長期国債	142	202	207
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	3.9
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	46
その他とも資産計	224	300	302
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	179
その他とも負債・純資産計	224	300	302

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
1/22	508(3M)	-0.0020%	-0.0048%
1/16	507(1Y)	-0.0119%	-0.0169%
1/15	506(3M)	-0.0020%	-0.0048%

1/22 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	196,303	-724	-1,005
	120,437	-	+281
	75,866	-	-

*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	0.060	0.074	-	0.069	0.115	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.120	-	0.260	0.118	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.089	-	0.119	0.118	0.118	0.115	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.079	0.100	-	0.063	0.061	0.059	0.055	-	0.042	0.050	0.058

§ 1/26 オフアーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.07%近辺で推移しよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

1/26 の予定(国内)

8:50 12月の貿易統計(財務省)
12/18-19の金融政策決定会合議事要旨

1/26 の予定(海外)

特になし

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	▲20,400	1,782,700	+1,782,700	0.050	0.070	0.070	0.070	0.075	0.080	0.110	0.120	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				
期間	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率		
2015/1/26 ~ 2015/4/27	8,000	2,911	2,911	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/1/19 ~ 2015/4/20	8,000	760	760	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/1/13 ~ 2015/4/13	8,000	910	910	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/1/5 ~ 2015/4/6	8,000	2,400	2,400	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2014/12/22 ~ 2015/3/23	8,000	1,031	1,031	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2014/12/12 ~ 2015/3/24	10,000	3,810	3,810	0.10%	固定金利	-	札割れ		
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		

共通担保資金供給(本店)					*当日物				
期間	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率		
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		

米ドル資金供給オペ

期間	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
1/23 ~ 1/29	担保範囲内	1	1	0.620%	固定金利	-	1.00
1/15 ~ 1/23	担保範囲内	10	10	0.610%	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