

DAILY SIGNAL

平成27年1月26日(月)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 1/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは130兆7,000億円。
無担ON物は朝方0.07%の取引から始まり、その後も同水準で推移した。
後場に入ってからも地合いに変化は見られず、そのまま引けた。
ターム物は1~2W物で0.11%台後半の出会い。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,307,000	+1,307,000

(単位:億円)

	日銀速報 1/26(月)		日銀予想 1/27(火)		当社需給予想				1/26 のオペ結果
					1/28(水)		1/29(木)		
債券		+700		+600	+1,000		+0		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(1/28-) (残存5年超10年以下) ▲0.025%按分(99.0%) 4,001億 (物価連動債) ▲0.360円按分(64.9%) 201億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政		▲19,900		+7,700	▲2,000		▲3,000		
過不足		▲19,200		+8,300	▲1,000		▲3,000		
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				+12,300					
国債短期証券買入				+30,000					
国債買現先									
共通担保(本店)	▲4,100	+2,900							
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲1,000		▲100						
社債等買入									
ETF買入		+300							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+100								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減		▲21,000		+50,500	+3,200		▲3,000		
当座預金残高		1,782,100		1,832,600	1,835,800		1,832,800		
準備預金残高		1,614,500	共通担保オペ当社予想					0	
積み終了先		1,299,800	ノオベ	ノオベ	ノオベ	ノオベ		0	
超過準備		1,299,700						75,979	
非準備預金残高		167,600						0	
準備預金進捗率		97.0%						0	
平均		35.5%	予想込増減	+50,500	予想込増減	+3,200	予想込増減	▲3,000	0
乖離率		61.5%	当預見込	1,832,600	当預見込	1,835,800	当預見込	1,832,800	0
								0	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,978,000
1/27 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 59,400
1/27 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 3,000

	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	0.085	0.075
ビッド	0.070	0.010	0.095	0.085
出来値	-	-	0.092	-

1/23 時点のマナターベース(単位:億円) **2,740,700**

(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%

1/23 のコール市場残高(前日比)

合計	195,569	-734
有担	118,954	-1,483
無担	76,615	+749

*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	0.073	-	0.117	0.118	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.119	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.071	0.083	0.125	0.118	0.132	0.118	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.074	0.086	-	0.063	0.060	0.058	0.054	-	0.040	0.050	0.058

§ 1/27 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%前後で推移しよう。
共通担保オペのオファーは見送られると予想する。

1/27 の予定(国内)

8:50 企業向けサービス価格指数(日銀)

1/27 の予定(海外)

米 FOMC(28日まで)

12月の新築住宅販売件数

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				
◎ ノオベ	+50,500	1,832,600	+1,832,600	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						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	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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	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
2015/1/19 ~ 2015/4/20	8,000	760	760	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/1/13 ~ 2015/4/13	8,000	910	910	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/1/5 ~ 2015/4/6	8,000	2,400	2,400	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率	1/23 ~ 1/29	担保範囲内	1	1	0.620%	固定金利	-	1.00
2014/12/22 ~ 2015/3/23	8,000	1,031	1,031	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/15 ~ 1/23	担保範囲内	10	10	0.610%	固定金利	-	1.00								
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																

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