

DAILY SIGNAL

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

§ 1/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは135兆4,000億円。
無担ON物は朝方0.07%近辺で取引され、その後も同水準で推移した。
後場からも地合いは変わらず、一部0.07%台半ばの出合いが見られた。
ターム物は1~2W物で0.11%台後半の出合い。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,354,000	+1,354,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/27 のオペ結果
	1/27(火)		1/28(水)		1/29(木)		1/30(金)		
券	+600		+400		+0		+0		9:20
財政	+8,900		+3,400		▲3,000		+2,000		ノーオペ
過不足	+9,500		+3,800		▲3,000		+2,000		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	ノーオペ
国債買入		+12,300		+4,400					10:40
国庫短期証券買入		+30,000							米ドル資金供給
国債買現先									(1/29-2/5)
共通担保(本店)									利率0.630% 0百万米ドル
共通担保(全店)									CP買入(1/30-)
CP買現先									0.091%按分(84.6%) 3,471億
CP等買入	▲100		▲200						11:50
社債等買入			▲100						国債補完供給
ETF買入				+400					(1/27-1/28)
J-REIT買入									応札0億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給									12:50
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	+51,700		+8,300		▲3,000		+5,500		
当座預金残高	1,833,800		1,842,100		1,839,100		1,844,600		
準備預金残高	1,657,100		1,657,100		1,657,100		1,657,100		
積み終り先	1,346,800		1,346,800		1,346,800		1,346,800		共通担保(本店) 0
超過準備	1,345,900		1,345,900		1,345,900		1,345,900		共通担保(全店) 75,979
非準備預金残高	176,700		176,700		176,700		176,700		国債買現先 0
準備預金進捗率	97.3%		97.3%		97.3%		97.3%		CP買現先 0
平均	38.7%		38.7%		38.7%		38.7%		成長基盤強化 44,120
乖離率	58.6%		58.6%		58.6%		58.6%		被災地金融機関支援 3,252
			予想込増減	+8,300	予想込増減	▲3,000	予想込増減	+5,500	ロンハート残高 0
			当預見込	1,842,100	当預見込	1,839,100	当預見込	1,844,600	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,978,000

1/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 53,300

1/28 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,800

	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	0.085	0.060
ビッド	0.070	0.010	0.095	0.070
出来値	-	-	0.092	-

1/26 時点のマネタリーベース(単位:億円) **2,719,000**

(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	回数	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%

1/26 のコール市場残高(前日比)			
合計	200,301		+4,732
有担	120,800		+1,846
無担	79,501		+2,886

*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	0.071	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.077	-	0.117	0.118	0.114	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.070	0.072	-	0.064	0.059	0.057	0.054	-	0.040	0.049	0.058

§ 1/28 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。
共通担保オペは実施されないと予想する。

1/28 の予定(国内)

特になし

1/28 の予定(海外)

米 FOMC結果公表
MBA住宅ローン申請指数

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出合いレンジ予想									
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	+8,300	1,842,100	+1,842,100	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
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
2015/1/19 ~ 2015/4/20	8,000	760	760	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
2015/1/13 ~ 2015/4/13	8,000	910	910	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2015/1/5 ~ 2015/4/6	8,000	2,400	2,400	0.10%	固定金利	-	札割れ	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							
2014/12/12 ~ 2015/3/24	10,000	3,810	3,810	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
2014/12/9 ~ 2015/3/20	10,000	5,655	5,655	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/29 ~ 2/5	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし
2014/12/8 ~ 2015/3/9	8,000	1,350	1,350	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/23 ~ 1/29	担保範囲内	1	1	0.620%	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