

DAILY SIGNAL

平成27年2月3日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは136兆3,000億円。
本日の無担ON物は朝方0.071%の出会いから始まり、その後も0.07~0.072%で推移した。
後場に入り、一部0.07%台前半の出会いが散見され引けた。
ターム物は1・2W物が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	-	-	1,363,000	+1,363,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/3 のオペ結果
	2/3(火)		2/4(水)		2/5(木)		2/6(金)		
券	+1,200		+1,100		+0		+0		9:20
財政	▲31,300		▲26,300		▲23,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲30,100		▲25,200		▲23,000		+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		+12,000		+4,900					10:40
国庫短期証券買入		+25,000							米ドル資金供給
国債買現先									(2/5-2/12)
共通担保(本店)									利率0.630% 0百万米ドル
共通担保(全店)							▲10,000		12:50
CP買現先									ノーオペ
CP等買入	▲300		▲100						13:00
社債等買入									ノーオペ
ETF買入				+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	+6,600		▲20,300		▲23,000		▲8,000		
当座預金残高	1,822,700		1,802,400		1,779,400		1,771,400		
準備預金残高	1,654,000		1,654,000		1,654,000		1,654,000		
積み終了先	1,358,800		1,358,800		1,358,800		1,358,800		共通担保(本店) 0
超過準備	1,358,700		1,358,700		1,358,700		1,358,700		共通担保(全店) 75,199
非準備先残高	168,700		168,700		168,700		168,700		国債買現先 0
準備預金進捗率	98.8%		98.8%		98.8%		98.8%		CP買現先 0
平均	61.3%		61.3%		61.3%		61.3%		成長基盤強化 44,120
乖離率	37.6%		37.6%		37.6%		37.6%		被災地金融機関支援 3,252
			予想込増減 ▲20,300	予想込増減 ▲23,000	予想込増減 ▲23,000	予想込増減 ▲23,000	予想込増減 ▲23,000	予想込増減 ▲23,000	ロンハート残高 0
			当預見込 1,802,400	当預見込 1,779,400	当預見込 1,779,400	当預見込 1,779,400	当預見込 1,779,400	当預見込 1,779,400	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,976,300
2/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 22,800
2/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,900

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.060	0.083	0.053
ビッド	0.070	0.030	0.092	0.060
出来値	-	-	0.088	-

2/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,751,300

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	1/31
長期国債	142	202	211
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	4.0
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	51
その他とも資産計	224	300	311
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	185
その他とも負債・純資産計	224	300	311

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
1/29	509(3M)	0.0000%	-0.0027%
1/22	508(3M)	-0.0020%	-0.0048%
1/16	507(1Y)	-0.0119%	-0.0169%

2/2 のコール市場残高(前日比)			
合計	201,554	-1,430	
有担	122,589	-1,388	
無担	78,965	-42	

*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	0.050	0.071	-	0.117	0.118	-	0.118	-	-	-	-
最高	0.135	0.123	-	0.119	0.310	-	0.630	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.074	-	0.118	0.121	-	0.126	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.059	0.059	-	0.058	0.055	0.054	0.053	-	0.039	0.048	0.058

§ 2/4 オファーのオペと市場動向予想

税揚げ日ではあるものの、引き続き0.07%台前半の取引となろう。共通担保オペは1兆5000億円のオファーを予想する。

2/4 の予定(国内)

若田日銀副総裁宮城県で挨拶(日銀)
10:30 12月の毎月勤労統計(厚労省)

2/4 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
12月のADP雇用統計
1月のISM非製造業指数

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	
◎	ノーオペ	▲20,300	1,802,400	+1,802,400	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2015/2/2 ~ 2015/5/7	8,000	770	770	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
2015/1/26 ~ 2015/4/27	8,000	2,911	2,911	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/1/19 ~ 2015/4/20	8,000	760	760	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ						期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率		
2015/1/13 ~ 2015/4/13	8,000	910	910	0.10%	固定金利	-	札割れ	2/5 ~ 2/12	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし	1/29 ~ 2/5	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし
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																

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