

DAILY SIGNAL

平成27年2月5日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/5 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは132兆3,000億円。
本日の無担ON物は朝方0.07%前半の出会いから始まり、その後も同水準で推移した。
後場に入り、調整程度の出合いが散見され引けた。また、一部市場参加者の試し取りが行われ0.12%台の出合いも見られた。ターム物は1・2W物で0.11%台後半で取引された。
本日実施された共通担保オペ(全店)は、2160億円の応札となり、ほぼ同額ロールとなった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,323,000	+1,323,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/5 のオペ結果
	2/5(木)		2/6(金)		2/9(月)		2/10(火)		
券	+200		+100		+1,000		+0		9:20
財政	▲16,600		▲4,100		▲20,000		▲9,000		ノオベ
過不足	▲16,400		▲4,000		▲19,000		▲9,000		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	ノオベ
国債買入				+12,000					10:40
国庫短期証券買入									CP等買入(2/10-)
国債買現先									0.091%按分(95.9%) 3,970億
共通担保(本店)			▲10,000	+13,600	▲2,400	+2,200	▲4,700		12:50
共通担保(全店)									ノオベ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲400		▲500					+4,000	共通担保オペ(全店)(固定金利方式)
社債等買入									(2/9-5/11)
ETF買入		+100		+300					0.10%(全取) 2,160億
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	▲16,700		+11,400		▲19,200		▲9,700		
当座預金残高	1,784,100		1,795,500		1,776,300		1,766,600		
準備預金残高	1,618,400		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +15,000		共通担保(本店) 0
積み終了先	1,326,300		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		75,199
超過準備	1,326,300		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		0
非準備先残高	165,700		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		0
準備預金進捗率	99.1%		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		0
平均	67.7%		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		44,120
乖離率	31.4%		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)		3,252
			予想込増減		▲11,400		▲19,200		被災地金融機関支援
			当預見込		1,795,500		1,776,300		ロンハート残高
					当預見込		1,781,600		0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,976,300
2/6以降の残り積み立て額(残り所要)積数 16,900
2/6以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,700

	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	0.065
ビッド	0.070	0.030	0.092	0.075
出来値	-	-	0.088	-

2/4 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,733,600

(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
2/5	510(3M)	0.0000%	-0.0015%
1/29	509(3M)	0.0000%	-0.0027%
1/22	508(3M)	-0.0020%	-0.0048%

2/4 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	204,325	-1,393	
	122,094	-1,252	
	82,231	-141	

*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	0.072	-	0.076	-	-	0.076	-	-	-	-
最高	0.135	0.120	-	0.117	-	-	0.170	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.080	-	0.101	0.118	-	0.110	-	-	-	-
東京レボレート	0.054	0.063	-	0.053	0.050	0.050	0.045	-	0.035	0.048	0.058

§ 2/6 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07~0.075%の水準で取引されよう。
共通担保オペは1兆5,000億円オファーされると予想する。

2/6 の予定(国内)

14:00 12月の景気動向指数(内閣府)
15:00 コール市場残高(1月)

2/6 の予定(海外)

米 1月の雇用統計
1月のISM製造業景況指数

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
◎ ノオベ	+11,400	1,795,500	+1,795,500	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
2015/2/9 ~ 2015/5/11	8,000	2,160	2,160	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
2015/2/6 ~ 2015/5/19	15,000	13,630	13,630	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
2015/2/2 ~ 2015/5/7	8,000	770	770	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
2015/1/26 ~ 2015/4/27	8,000	2,911	2,911	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
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							
2015/1/13 ~ 2015/4/13	8,000	910	910	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
2015/1/5 ~ 2015/4/6	8,000	2,400	2,400	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
2014/12/22 ~ 2015/3/23	8,000	1,031	1,031	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

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