

DAILY SIGNAL

平成27年2月6日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは134兆6,000億円。
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0.072~0.075%で推移した。
後場に入っても地合いに変化はなく、一部調整程度の出合いが散見され引けた。
ターム物は1W物が0.11%台後半で取引された。本日久札が実施されたTDB(第511回、6M)の
最高利回りは▲0.002%となり、前回債(505回、6M、最高利回り▲0.0061%)から上昇した。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,346,000	+1,346,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/6 のオペ結果
	2/6(金)		2/9(月)		2/10(火)		2/12(木)		
券	+200		+1,100		+0		+1,000		9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(2/10-) (残存1年超3年以下) +0.003%按分(59.3%) 4,001億 (残存3年超5年以下) +0.008%按分(41.3%) 4,003億 (残存10年超25年以下) +0.002%按分(8.3%) 2,402億 (残存25年超) ▲0.005%按分(90.6%) 1,402億 11:50 国債補完供給(2/6-2/9) ▲0.400%全取 15億 12:50 ノーオペ 13:00 共通担保オペ(全店)(固定金利方式) (2/10-5/22) 0.10%(全取) 3,600億
財政	▲2,900		▲25,100		▲9,000		+1,000		
過不足	▲2,700		▲24,000		▲9,000		+2,000		
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	+12,000				+11,800				
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲10,000	+13,600	▲2,400	+2,200	▲4,700	+3,600			
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲300			+4,000			
社債等買入									
ETF買入									
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	+12,700		▲24,200		+5,700		+2,000		
当座預金残高	1,796,800		1,772,600		1,778,300		1,780,300		
準備預金残高	1,632,700								
積み終了先	1,344,700								
超過準備	1,344,400								
非準備先残高	164,100								
準備預金進捗率	99.4%								
平均	77.4%		予想込増減 ▲24,200		予想込増減 +5,700		予想込増減 +2,000		
乖離率	22.0%		当預見込 1,772,600		当預見込 1,778,300		当預見込 1,780,300		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							78,798		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							44,120		
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) 1,986,300
2/9以降の残り積み立て額(残り所要)積数 11,400
2/9以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,600

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.060	0.083	0.090
ビッド	0.070	0.030	0.092	0.100
出来値	-	-	0.088	-

2/5 時点のマナタリーベース(単位:億円) 2,716,800

(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
2/6	511(6M)	-0.0020%	-0.0040%
2/5	510(3M)	0.0000%	-0.0015%
1/29	509(3M)	0.0000%	-0.0027%

2/5 のコール市場残高(前日比)			
合計	204,000		-325
有担	120,284		-1,810
無担	83,716		+1,485

*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	0.030	0.073	-	0.071	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.080	0.120	-	0.260	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.077	-	0.121	0.118	-	0.150	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.065	0.088	-	0.054	0.050	0.050	0.045	-	0.035	0.048	0.058

§ 2/9 オフアのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は引き続き0.07%台前半で取引されよう。共通担保オペはノーオペを予想する。

2/9 の予定(国内)

8:50 12月の国際収支(財務省)
1月の対外対内証券売買契約等の状況(財務省)
14:00 1月の消費動向調査(内閣府)

2/9 の予定(海外)

米 FRBの1月の労働市場情勢指数

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	▲24,200	1,772,600	+1,772,600	0.050	0.070	0.070	0.070	0.075	0.080	0.110	0.120	0.200
				~	~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.125	0.150	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	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2015/2/10 ~ 2015/5/22	8,000	3,600	3,600	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
2015/2/9 ~ 2015/5/11	8,000	2,160	2,160	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
2015/2/6 ~ 2015/5/19	15,000	13,630	13,630	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ					期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率			
2015/2/2 ~ 2015/5/7	8,000	770	770	0.10%	固定金利	-	札割れ	2/5 ~ 2/12	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし								
2015/1/26 ~ 2015/4/27	8,000	2,911	2,911	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								
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																

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