

DAILY SIGNAL

平成27年2月16日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは137兆1000億円だった。
本日の無担ON物は朝方0.073%の出会いから始まり、その後は0.070~0.075%のレンジで取引された。後場では調整程度の出合いが見られ、引けた。
また一部で試取の動きが見られ、0.125%での出合いが散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,371,000	+1,355,967

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/16 のオペ結果
	2/16(月)		2/17(火)		2/18(水)		2/19(木)		
券	+1,000		+100		+0		▲2,000		9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(2/18-) (残存1年超3年以下) +0.001%按分(73.1%) 4,003億 (残存3年超5年以下) +0.010%按分(66.5%) 4,002億 (残存5年超10年以下) +0.020%按分(66.6%) 4,007億 11:50 国債補完供給(2/16-2/17) ▲0.400% 381億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
財政	▲32,300		▲20,600		▲1,000		▲12,000		
過不足	▲31,300		▲20,500		▲1,000		▲14,000		
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	+8,000				+12,000				
国庫短期証券買入			+20,000						
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲3,400	+1,800	▲12,700	+4,700					
CP買現先			▲200						
CP等買入	▲800								
社債等買入	▲100				+1,000				
ETF買入							+300		
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出			▲100						
国債補完供給	+300	▲400	+400						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲25,600		▲8,400		+12,000		▲14,000		
当座預金残高	1,838,500		1,830,100		1,842,100		1,828,100		
準備預金残高	1,670,700								
積み終了先	451,600								
超過準備	343,200								
非準備先残高	167,800								
準備預金進捗率	57.9%								
平均	3.6%		予想込増減 ▲8,400		予想込増減 +12,000		予想込増減 ▲14,000		
乖離率	54.3%		当預見込 1,830,100		当預見込 1,842,100		当預見込 1,828,100		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							74,828		
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							100		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,776,900

2/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 748,300

2/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 27,700

	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	0.085	0.065
ビッド	0.070	0.030	0.093	0.075
出来値	-	-	0.090	-

2/13 時点のマナタリーベース(単位:億円) 2,795,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	2/10
長期国債	142	202	215
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	4.2
J-REIT	0.14	0.18	0.19
貸出支援基金	9.2	25	25
国庫短期証券	40	49	49
その他とも資産計	224	300	313
銀行券	90	93	88
当座預金	107	178	178
その他とも負債・純資産計	224	300	313

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
2/12	512(3M)	0.0020%	-0.0004%
2/6	511(6M)	-0.0020%	-0.0040%
2/5	510(3M)	0.0000%	-0.0015%

2/13 のコール市場残高(前日比)

合計	200,256	-2,425
有担	121,300	-162
無担	78,956	-2,263

*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	0.073	0.100	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.125	0.125	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.099	0.101	0.090	-	-	0.170	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.061	0.072	-	0.053	0.051	0.050	0.045	-	0.037	0.048	0.058

§ 2/17 オファーのオペと市場動向予想

翌営業日の足許金利は0.07%台前半を中心に
取引されよう。期落ちが無い事から共通担保オペは
ノーオペを予想する。

2/17 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(18日まで)

2/17 の予定(海外)

米 2月のNY連銀製造業景況感指数
米 ハウエルFRB理事の講演
欧 EU財務相理事会(ブリュッセル)

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	▲8,400	1,830,100	+1,830,100	0.060	0.070	0.070	0.070	0.075	0.080	0.110	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
2015/2/17 ~ 2015/5/29	15,000	4,711	4,711	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
2015/2/16 ~ 2015/5/18	8,000	1,751	1,751	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
2015/2/13 ~ 2015/5/26	15,000	3,860	3,860	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	按分レド	平均レド	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	2/12 ~ 2/20	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし								
2015/2/9 ~ 2015/5/11	8,000	2,160	2,160	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								
2015/2/6 ~ 2015/5/19	15,000	13,630	13,630	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/2/2 ~ 2015/5/7	8,000	770	770	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/1/26 ~ 2015/4/27	8,000	2,911	2,911	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