

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
財政	▲32,300		▲20,600		▲1,000		▲12,000		ノーオペ
過不足	▲31,300		▲20,500		▲1,000		▲14,000		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	国債買入(2/18-)
国債買入		+8,000				+12,000			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入				+20,000					+0.001%按分(73.1%) 4,003億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)	▲3,400	+1,800	▲12,700	+4,700					+0.010%按分(66.5%) 4,002億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									+0.020%按分(66.6%) 4,007億
CP等買入	▲800		▲200						11:50
社債等買入	▲100					+1,000			国債補完供給(2/16-2/17)
ETF買入		+300							▲0.400% 381億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出				▲100					13:00
国債補完供給	+300	▲400	▲400						ノーオペ
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		1,670,700		1,670,700		1,670,700		共通担保(本店) 0
積み終了先	451,600		451,600		451,600		451,600		共通担保(全店) 74,828
超過準備	343,200		343,200		343,200		343,200		国債買現先 0
非準備預金残高	167,800		167,800		167,800		167,800		CP買現先 0
準備預金進捗率	57.9%		57.9%		57.9%		57.9%		成長基盤強化 44,120
平均	3.6%		3.6%		3.6%		3.6%		被災地金融機関支援 3,252
乖離率	54.3%		54.3%		54.3%		54.3%		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 時点のマネタリーベース(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				
2015/2/17 ~ 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				
2015/2/16 ~ 2015/5/18	8,000	1,751	1,751	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				
2015/2/13 ~ 2015/5/26	15,000	3,860	3,860	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				
2015/2/10 ~ 2015/5/22	8,000	3,600	3,600	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70				
2015/2/9 ~ 2015/5/11	8,000	2,160	2,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/2/6 ~ 2015/5/19	15,000	13,630	13,630	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				
2015/2/2 ~ 2015/5/7	8,000	770	770	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				
2015/1/26 ~ 2015/4/27	8,000	2,911	2,911	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				

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