

DAILY SIGNAL

平成27年2月17日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは136兆4000億円だった。
本日の無担ON物は朝方0.073%の出会いからスタート。その後は0.070~0.073%のレンジで取引された。後場では調整程度の出が見られた。
引き続き一部で試取の動きが見られ、0.125%での出が散見された。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,364,000	+1,364,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/17 のオペ結果
	2/17(火)		2/18(水)		2/19(木)		2/20(金)		
券	+0		▲400		▲2,000		▲2,000		9:20
財政	▲19,600		▲800		▲12,000		▲16,000		ノオベ
過不足	▲19,600		▲1,200		▲14,000		▲18,000		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		+20,000							CP等買入(2/20-)
国債買現先									0.092%按分(82.5%) 3,995億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)	▲12,700	+4,700					▲12,800		国債補完供給(2/17-2/18)
CP買現先			▲200						▲0.400% 7億
CP等買入	▲200							+4,000	12:50
社債等買入				+1,000					ノオベ
ETF買入				+200					13:00
J-REIT買入									ノオベ
被災地金融機関支援									13:50
貸出	+0								国債補完供給(2/17-2/18)
国債補完供給	+400	▲200	+200						▲0.400%全取 122億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲7,600		+12,000		▲14,000		▲26,800		
当座預金残高	1,830,900		1,842,900		1,828,900		1,802,100		
準備預金残高	1,662,500								共通担保(本店)
積み終了先	1,259,400		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +15,000		0
超過準備	888,000								共通担保(全店)
非準備先残高	168,400								国債買現先
準備預金進捗率	84.7%								CP買現先
平均	7.1%		予想込増減 +12,000		予想込増減 ▲14,000		予想込増減 ▲11,800		成長基盤強化
乖離率	77.6%		当預見込 1,842,900		当預見込 1,828,900		当預見込 1,817,100		被災地金融機関支援
									ロンハート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,776,900
2/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 271,800
2/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 10,500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.060	0.085	0.055
ビッド	0.070	0.030	0.093	0.070
出来値	-	-	0.090	-

2/16 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,768,400

(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
2/17	513(1Y)	0.0000%	-0.0009%
2/12	512(3M)	0.0020%	-0.0004%
2/6	511(6M)	-0.0020%	-0.0040%

2/16 のコール市場残高(前日比)

	合計	206,931	+6,675
有担	126,013	+4,713	
無担	80,918	+1,962	

*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	0.071	-	-	0.200	-	-	-	-	-	-
最高	0.128	0.125	-	-	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.079	0.082	0.110	-	0.218	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.062	0.073	-	0.053	0.051	0.050	0.045	-	0.038	0.048	0.058

§ 2/18 オフア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。共通担保オペは期落ち分に対して
1兆5000億円ロールオフアされると予想する。

2/18 の予定(国内)

未定 日銀金融政策決定会合(結果)
黒田日銀総裁会見

2/18 の予定(海外)

米 1月27日~28日のFOMC議事録
週間のMBA住宅ローン申請指数
1月住宅着工件数

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	+12,000	1,842,900	+1,842,900	0.060	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
2015/2/17 ~ 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	8,003	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	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