

DAILY SIGNAL

平成27年2月19日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/19 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは135兆4000億円だった。
本日の無担ON物は朝方0.074%の出会いから始まり、その後0.070~0.074%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た。
引き続き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	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,354,000	+1,354,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/19 のオペ結果
	2/19(木)		2/20(金)		2/23(月)		2/24(火)		
券	▲1,100		▲1,300		+0		▲1,000		9:20
財政	▲12,500		▲20,100		▲19,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲13,600		▲21,400		▲19,000		+1,000		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	ノーオペ
国債買入									12:50
国庫短期証券買入									ノーオペ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)			▲12,800	+11,800	▲2,700	+2,500			共通担保オペ(全店)(固定金利方式)
共通担保(全店)									(2/23-5/25)
CP買現先									0.10%(全取) 2451億
CP等買入	▲200		▲800	+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			▲100						
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	▲13,800		▲19,300		▲19,200		+1,000		
当座預金残高	1,829,300		1,810,000		1,790,800		1,791,800		
準備預金残高	1,657,900		1,316,400		共通担保オペ当社予想		共通担保(本店)		0
積み終了先	1,316,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
超過準備	1,310,200		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		66,829
非準備先残高	171,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先
準備預金進捗率	92.1%		92.1%		92.1%		92.1%		0
平均	14.3%		14.3%		14.3%		14.3%		CP買現先
乖離率	77.8%		77.8%		77.8%		77.8%		0
			予想込増減	▲19,300	予想込増減	▲19,200	予想込増減	+1,000	成長基盤強化
			当預見込	1,810,000	当預見込	1,790,800	当預見込	1,791,800	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
2/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 140,400
2/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 5,900

	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	0.072	0.090
ビッド	0.070	0.030	0.105	0.100
出来値	-	-	-	-

2/18 時点のマネタリベース(単位:億円) 2,773,400

(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
2/19	514(3M)	0.0060%	0.0036%
2/17	513(1Y)	0.0000%	-0.0009%
2/12	512(3M)	0.0020%	-0.0004%

2/18 のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
208,344	-3,134	-1,649
126,063	-	-1,485
82,281	-	-

*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	0.074	-	-	0.115	-	0.118	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	-	0.118	-	0.120	-	-	-	-
加重平均	0.082	0.088	-	0.117	0.118	0.118	0.119	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.061	0.086	-	0.053	0.050	0.049	0.045	-	0.036	0.048	0.058

§ 2/20 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。共通担保オペはノーオペを予想する。

2/20 の予定(国内)

9:00 1月公社債投資家別売買状況(日証協)

2/20 の予定(海外)

欧 2月の製造業PMI速報
2月のサービス業PMI速報

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	▲19,300	1,810,000	+1,810,000	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				
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	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				
2015/2/20 ~ 2015/6/2	15,000	11,800	11,800	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				
2015/2/17 ~ 2015/5/29	15,000	4,711	4,711	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				
2015/2/16 ~ 2015/5/18	8,000	1,751	1,751	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				
2015/2/13 ~ 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											
2015/2/10 ~ 2015/5/22	8,000	3,600	3,600	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				
2015/2/9 ~ 2015/5/11	8,000	2,160	2,160	0.10%	固定金利	-	札割れ	2/20 ~ 2/26	担保範囲内	3	3	0.620%	固定金利	-	1.00				
2015/2/6 ~ 2015/5/19	15,000	13,630	13,630	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	-	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