

DAILY SIGNAL

平成27年2月20日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは135兆1000億円だった。
本日の無担ON物は朝方0.075%の出会いから始まり、その後0.073~0.074%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。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,351,000	+1,351,000

(単位:億円)

	日銀速報 2/20(金)		日銀予想 2/23(月)		当社需給予想				2/20 のオペ結果
	2/24(火)	2/25(水)							
券	▲1,300		▲100		▲1,000		▲1,000		9:20 ノオベ 10:10 国庫短期証券買入(2/24-) ▲0.001%按分(2.8%) 25,002億 国債買入(2/24-) (残存1年超3年以下) ▲0.008%按分(10.9%) 4,001億 (残存3年超5年以下) ▲0.009%按分(8.0%) 4,000億 (残存10年超25年以下) ▲0.015%按分(73.3%) 2,401億 (残存25年超) ▲0.012%按分(43.8%) 1,404億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲19,800		▲17,900		+2,000		+0		
過不足	▲21,100		▲18,000		+1,000		▲1,000		
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						+11,800			
国庫短期証券買入						+25,000			
国債買現先									
共通担保(本店)	▲12,800	+11,800	▲2,700	+2,500					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲800	+4,000	▲400						
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	▲18,900		▲18,400		+37,800		▲1,000		
当座預金残高	1,810,400		1,792,000		1,829,800		1,828,800		
準備預金残高	1,644,600		1,331,400		共通担保オペ当社予想		共通担保(本店) 0		
積み終了先	1,331,400		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 65,829		
超過準備	1,323,100		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0		
非準備先残高	165,800		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0		
準備預金進捗率	96.2%		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化 44,120		
平均	25.0%		予想込増減 ▲18,400		予想込増減 +37,800		予想込増減 ▲1,000		
乖離率	71.2%		当預見込 1,792,000		当預見込 1,829,800		当預見込 1,828,800		
							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) 1,776,900
2/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 67,400
2/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 3,200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.060	0.072	0.070
ビッド	0.070	0.000	0.105	0.080
出来値	-	-	-	-

2/19 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,760,700

(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%

2/19 のコール市場残高(前日比)			
合計	有担	無担	
204,556	128,587	75,969	-3,788
			+2,524
			-6,312

*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	0.073	-	0.070	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.125	-	0.260	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.086	-	0.129	0.118	-	0.118	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.064	0.098	-	0.055	0.052	0.049	0.045	-	0.037	0.048	0.058

§ 2/23 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。共通担保オペはノオベを予想する。

2/23 の予定(国内)

8:50 1月20日~21日の金融政策会合
議事要旨(日銀)

2/23 の予定(海外)

米 1月の中古住宅販売件数

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	▲18,400	1,792,000	+1,792,000	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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	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	8,003	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											
2015/2/10 ~ 2015/5/22	8,000	3,600	3,600	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	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	-	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