

DAILY SIGNAL

平成27年2月24日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/24 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0.074%の出会いから始まり、その後は0.075%近辺での取引が中心となった。後場に入ると0.07%の出会いも見られて引けた。
引続き、試取りの動きが複数件見られたことから0.12%超の取引も見られた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,371,000	+1,371,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/24 のオペ結果
	2/24(火)		2/25(水)		2/26(木)		2/27(金)		
券	▲1,300		▲1,200		▲2,000		▲2,000		9:20
財政	+4,000		+3,100		▲5,000		+5,000		ノーオペ
過不足	+2,700		+1,900		▲7,000		+3,000		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		+12,200		+5,500					10:40
国庫短期証券買入		+25,000							米ドル資金供給
国債買現先									(2/26-3/5)
共通担保(本店)									利率0.620% 0百万米ドル
共通担保(全店)									CP等買入(2/27-)
CP買現先									0.091%按分(11.7%) 3,981億
CP等買入	▲200		▲400						12:50
社債等買入			▲300						ノーオペ
ETF買入				+100					13:00
J-REIT買入									ノーオペ
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			▲100						
当座預金増減	+39,700		+6,700		▲7,000		+7,000		
当座預金残高	1,830,800		1,837,500		1,830,500		1,837,500		
準備預金残高	1,666,600		1,360,000		1,360,000		1,360,000		共通担保(本店) 0
積み終了先	1,360,000		1,360,000		1,360,000		1,360,000		共通担保(全店) 65,630
超過準備	1,360,000		1,360,000		1,360,000		1,360,000		国債買現先 0
非準備先残高	164,200		164,200		164,200		164,200		CP買現先 0
準備預金進捗率	97.6%		97.6%		97.6%		97.6%		成長基盤強化 44,120
平均	32.1%		32.1%		32.1%		32.1%		被災地金融機関支援 3,252
乖離率	65.5%		65.5%		65.5%		65.5%		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,776,900

2/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 42,300

2/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.050	0.072	0.065
ビッド	0.075	-	0.105	0.075
出来値	-	-	-	-

2/23 時点のマネタリベース(単位:億円) 2,724,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	2/20
長期国債	142	202	216
CP等	2.2	2.2	2.4
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	4.3
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	52
その他とも資産計	224	300	317
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	181
その他とも負債・純資産計	224	300	317

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%

2/23 のコール市場残高(前日比)

	合計	203,494	-2,569
有担	127,884	-1,731	
無担	75,610	-838	

*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	0.050	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.077	0.081	-	0.117	0.310	-	0.145	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.060	0.066	-	0.054	0.051	0.049	0.045	-	0.037	0.048	0.058

§ 2/25 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%台半ばを中心に
取引されよう。共通担保オペはノーオペを予想する。

2/25 の予定(国内)

国の債務管理の在り方に関する懇談会
(財務省)

日銀と市場関係者との市場調節懇談会

2/25 の予定(海外)

米 MBA住宅ローン申請指数
1月の新築住宅販売件数
FRB議長の下院議会証言

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	
◎	ノーオペ	+6,700	1,837,500	+1,837,500	0.050	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				
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		
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/2/20 ~ 2015/6/2	15,000	11,800	11,800	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/2/17 ~ 2015/5/29	15,000	4,711	4,711	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/2/16 ~ 2015/5/18	8,000	1,751	1,751	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/2/13 ~ 2015/5/26	15,000	3,860	3,860	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/2/10 ~ 2015/5/22	8,000	3,600	3,600	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/2/9 ~ 2015/5/11	8,000	2,160	2,160	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/2/6 ~ 2015/5/19	15,000	13,630	13,630	0.10%	固定金利	-	札割れ		

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		
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		
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		
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		
2/26 ~ 3/5	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし		
2/20 ~ 2/26	担保範囲内	3	3	0.620%	固定金利	-	1.00		

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