

DAILY SIGNAL

平成27年2月25日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/25 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは137兆5000億円だった。
本日の無担ON物は朝方0.074%の出合から始まり、その後は0.075%近辺で取引された。後場に入ると0.07%の出合も見られて引けた。
本日は、試取りの動きが複数件重なったことで、0.12%超の取引が多く出合った。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,375,000	+1,375,000

(単位:億円)

	日銀速報 2/25(水)		日銀予想 2/26(木)		当社需給予想 2/27(金)		3/2(月)	2/25 のオペ結果 9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(2/27-) (残存1年超3年以下) ▲0.010%按分(11.9%) 4,001億 (残存3年超5年以下) ▲0.004%按分(34.9%) 4,004億 (残存10年超25年以下) ▲0.025%按分(50.7%) 2,402億 (残存25年超) ▲0.014%按分(100.0%) 1,405億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
券	▲1,400		▲2,100		▲2,000		+1,000	
財政	+3,100		▲3,300		+5,000		▲18,000	
過不足	+1,700		▲5,400		+3,000		▲17,000	
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	
国債買入		+5,500				+11,800		
国庫短期証券買入								
国債買現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)							▲2,100	
CP買現先								
CP等買入	▲400		▲600			+4,000		
社債等買入	▲300							
ETF買入		+100						
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	+6,600		▲6,000		+18,800		▲19,100	
当座預金残高	1,837,400		1,831,400		1,850,200		1,831,100	
準備預金残高	1,666,500							
積み終了先	1,361,700							
超過準備	1,360,500							
非準備預金残高	170,900							
準備預金進捗率	98.1%							
平均	35.7%		予想込増減 ▲6,000		予想込増減 +18,800		予想込増減 ▲11,100	
乖離率	62.4%		当預見込 1,831,400		当預見込 1,850,200		当預見込 1,839,100	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,776,900
2/26 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 33,800
2/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,900

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.050	0.072	0.070
ビッド	0.075	0.010	0.105	0.085
出来値	-	-	-	-

2/24 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,765,100

(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%

2/24 のコール市場残高(前日比)

合計	202,186	-1,308
有担	126,781	-1,103
無担	75,405	-205

*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	0.030	0.074	-	0.105	0.110	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.125	-	0.117	0.118	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.086	0.083	-	0.109	0.112	-	0.144	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.055	0.065	-	0.053	0.050	0.048	0.045	-	0.037	0.048	0.058

§ 2/26 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台半ばを中心に
取引されよう。共通担保オペは期落ち分に対して
8000億円ロールオファーされると予想する。

2/26 の予定(国内)

8:50 2月上旬の貿易統計(財務省)
黒田日銀総裁が参院財政金融委員会で説明
石田日銀審議委員が神奈川で会見

2/26 の予定(海外)

米 新規失業保険申請件数
1月の消費者物価
1月の耐久財受注

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
◎ ノーオペ	▲6,000	1,831,400	+1,831,400	0.050	0.070	0.070	0.070	0.075	0.080	0.110
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.125	0.150	0.170

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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	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	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/2/20 ~ 2015/6/2	15,000	11,800	11,800	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	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
2015/2/17 ~ 2015/5/29	15,000	4,711	4,711	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/2/16 ~ 2015/5/18	8,000	1,751	1,751	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	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
2015/2/13 ~ 2015/5/26	15,000	3,860	3,860	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								
2015/2/10 ~ 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																

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ありません。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