

DAILY SIGNAL

平成27年1月28日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは136兆4,000億円。
無担ON物は一部金融機関による試し取りで0.08%の取引から始まり、その後0.125%まで出合った。試し取りの動きを除くと一日を通して0.07%近辺での推移となった。無担ON物加重平均金利は0.087%(前日比+0.014%)と2014年12月11日(0.085%)以来、約1か月ぶりの高水準を記録した。

(単位:億円)

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/28 のオペ結果
	1/28(水)		1/29(木)		1/30(金)		2/2(月)		
券	+500		▲500		+0		+2,000		9:20
財政	+3,000		▲3,900		+2,000		▲30,000		ノーオペ
過不足	+3,500		▲4,400		+2,000		▲28,000		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	国債買入(1/30-)
国債買入		+4,400				+12,000			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.013%按分(95.1%) 4,002億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.002%按分(23.9%) 4,005億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.008%按分(63.1%) 4,006億
CP等買入	▲200		▲200			+3,500			11:50
社債等買入	▲100		▲200						国債補完供給
ETF買入		+400		+100					(1/28-1/29)
J-REIT買入									応札0億
被災地金融機関支援貸出									12:50
国債補完供給		▲100	+100						ノーオペ
成長基盤強化支援貸出増加支援									13:00
									ノーオペ
									13:50
									国債補完供給
									(1/28-1/29)
									▲0.400%全取 78億
当座預金増減	+7,900		▲4,600		+17,500		▲29,600		
当座預金残高	1,841,700		1,837,100		1,854,600		1,825,000		
準備預金残高	1,651,400		1,646,800		1,664,300		1,634,700		
積み終了先	1,345,000		1,340,400		1,357,900		1,328,300		共通担保(本店) 0
超過準備	1,344,900		1,340,300		1,357,800		1,328,200		共通担保(全店) 75,979
非準備預金残高	190,300		206,500		206,500		6,500		国債買現先 0
準備預金進捗率	97.5%		95.6%		95.5%		96.4%		CP買現先 0
平均	41.9%		41.9%		41.9%		41.9%		成長基盤強化 44,120
乖離率	55.6%		55.6%		55.6%		55.6%		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) 1,978,000
1/29 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 48,600
1/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,700

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.050	0.085	0.060
ビッド	0.070	0.010	0.095	0.070
出来値	-	-	0.092	-

1/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) **2,770,200**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	1/20
長期国債	142	202	207
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	3.9
J-REIT	0.14	0.18	0.18
貸出支援基金	9.2	25	25
国庫短期証券	40	49	46
その他とも資産計	224	300	302
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	179
その他とも負債・純資産計	224	300	302

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
1/22	508(3M)	-0.0020%	-0.0048%
1/16	507(1Y)	-0.0119%	-0.0169%
1/15	506(3M)	-0.0020%	-0.0048%

1/27 のコール市場残高(前日比)

	合計	204,067	+3,766
有担	122,486	+1,686	
無担	81,581	+2,080	

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

無担コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	0.055	0.070	-	0.081	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.087	0.090	-	0.093	0.118	0.140	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.063	0.069	-	0.060	0.058	0.057	0.054	-	0.039	0.048	0.058

§ 1/29 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%近辺で推移しよう。
T+2スタートの共通担保オペが実施されると予想する。

1/29 の予定(国内)

8:50 対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

1/29 の予定(海外)

米 新規失業保険申請件数
12月の中古住宅販売仮契約

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	▲4,600	1,837,100	+1,837,100	0.050	0.070	0.070	0.070	0.075	0.080	0.110	0.120	0.200							
					~	~	~	~	~	~	~	~	~							
					0.125	0.125	0.130	0.135	0.140	0.145	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	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
2015/1/26 ~ 2015/4/27	8,000	2,911	2,911	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
2015/1/19 ~ 2015/4/20	8,000	760	760	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
2015/1/13 ~ 2015/4/13	8,000	910	910	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/1/5 ~ 2015/4/6	8,000	2,400	2,400	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	1/29 ~ 2/5	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応札なし
2014/12/22 ~ 2015/3/23	8,000	1,031	1,031	0.10%	固定金利	-	札割れ	1/23 ~ 1/29	担保範囲内	1	1	0.620%	固定金利	-	1.00								
2014/12/12 ~ 2015/3/24	10,000	3,810	3,810	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2014/12/9 ~ 2015/3/20	10,000	5,655	5,655	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2014/12/8 ~ 2015/3/9	8,000	1,350	1,350	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