

DAILY SIGNAL

平成27年3月2日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは137兆2,000億円。
無担ON物は朝方0.075%の出合から始まり、その後も0.075%近辺で推移した。後場に入るとビッドは薄くなり、0.07%前半での取引が中心となった。ターム物では2W物で0.11%台後半の取引が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,372,000	+1,372,000

(単位:億円)

	日銀速報 3/2(月)		日銀予想 3/3(火)		当社需給予想				3/2 のオペ結果
	3/4(水)	3/5(木)	3/4(水)	3/5(木)	3/4(水)		3/5(木)		
券	+700		+300		+1,000		+0		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(3/4-) (残存1年以下) +0.043%按分(99.8%) 500億 (残存10年超25年以下) ▲0.004%按分(73.1%) 2,407億 (残存25年超) ▲0.009%按分(9.9%) 1,404億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲23,300		▲12,200		▲39,000		+5,000		
過不足	▲22,600		▲11,900		▲38,000		+5,000		
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				+12,100		+4,300			
国庫短期証券買入				+15,000					
国債買現先									
共通担保(本店)	▲2,100	+2,200							
共通担保(全店)			▲300						
CP買現先									
CP等買入	▲700								
社債等買入	▲200								
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	▲23,400		+14,900		▲33,700		+5,000		
当座預金残高	1,825,200		1,840,100		1,806,400		1,811,400		
準備預金残高	1,658,200		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	1,364,900		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	1,364,600		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備先残高	167,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	99.2%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	53.6%		予想込増減 +14,900		予想込増減 ▲33,700		予想込増減 +5,000		
乖離率	45.7%		当預見込 1,840,100		当預見込 1,806,400		当預見込 1,811,400		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							65,790		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							44,120		
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) 1,774,900
3/3以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 13,600
3/3以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,000

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	-	0.072	0.040
ビッド	0.075	-	0.105	0.055
出来値	-	-	-	-

2/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,788,700

(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
2/26	515(3M)	0.0020%	-0.0024%
2/19	514(3M)	0.0060%	0.0036%
2/17	513(1Y)	0.0000%	-0.0009%

2/27 のコール市場残高(前日比)		
合計	201,319	-1,876
有担	127,711	+753
無担	73,608	-2,629

*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	0.074	-	0.095	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	0.118	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.081	-	0.106	0.118	0.120	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.059	0.053	-	0.052	0.049	0.047	0.034	-	0.037	0.048	0.057

§ 3/3 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.07%台半ばを中心に推移しよう。
共通担保オペはオファーされないと予想する。

3/3 の予定(国内)

8:50 2月のマネタリーベース(日銀)
10:00 2/28現在の営業毎旬報告(日銀)
10:30 1月の毎月勤労統計(厚労省)

3/3 の予定(海外)

米 FRB改革で公聴会

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
◎ ノオベ	+14,900	1,840,100	+1,840,100	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					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				
2015/3/2 ~ 2015/6/1	8,000	2,230	2,230	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				
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	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				
2015/2/20 ~ 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				
2015/2/17 ~ 2015/5/29	15,000	4,711	4,711	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				
2015/2/16 ~ 2015/5/18	8,000	1,751	1,751	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/2/13 ~ 2015/5/26	15,000	3,860	3,860	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				
2015/2/10 ~ 2015/5/22	8,000	3,600	3,600	0.10%	固定金利	-	札割れ	2/26 ~ 3/5	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし				
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				

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