

DAILY SIGNAL

平成27年3月9日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは136兆2,000億円。
無担ON物は朝方0.075%の出会いから始まり、その後は0.07~0.075%で推移した。
一部試し取りの動きから0.12%台の出会いも散見された。後場に入り、調整程度の
出会いが見られ引けた。
ターム物は1W物が0.11%後半で取引された。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,362,000	+1,362,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/9 のオペ結果
	3/9(月)		3/10(火)		3/11(水)		3/12(木)		
券	+1,300		+900		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲8,800		▲9,000		+2,000		▲3,000		10:10 国庫短期証券買入(3/11-)
過不足	▲7,500		▲8,100		+2,000		▲3,000		+0.002%按分(11.6%) 10,001億
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	11:50 国債補完供給(3/9-3/10)
国債買入				+10,700					▲0.400%全取 228億
国庫短期証券買入						+10,000			
国債買現先									
共通担保(本店)									12:50 ノーオペ
共通担保(全店)	▲1,400	+1,000							13:00 ノーオペ
CP買現先			▲900						13:50 国債補完供給(3/9-3/10)
CP等買入	▲300					+5,000			▲0.400%全取 160億
社債等買入									
ETF買入				+200					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援 貸出			+400						
国債補完供給		▲400							
成長基盤強化支援 貸出増加支援									
当座預金増減	▲8,600		+2,300		+17,000		▲3,000		
当座預金残高	1,817,000		1,819,300		1,836,300		1,833,300		
準備預金残高	1,656,100								
積み終り先	1,364,000								共通担保(本店) 0
超過準備	1,364,000								共通担保(全店) 65,430
非準備預金残高	160,900								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.7%								CP買現先 0
平均	78.6%		予想込増減 +2,300		予想込増減 +17,000		予想込増減 ▲3,000		成長基盤強化 46,757
乖離率	21.1%		当預見込 1,819,300		当預見込 1,836,300		当預見込 1,833,300		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) 1,777,500

3/10 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 6,100

3/10 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	0.050	0.075	0.020
ビッド	0.075	0.020	0.095	0.040
出来値	-	-	0.080	-

3/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,764,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	2/28
長期国債	142	202	219
CP等	2.2	2.2	2.3
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	53
その他とも資産計	224	300	320
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	185
その他とも負債・純資産計	224	300	320

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
3/6	517(6M)	-0.0019%	-0.0059%
3/5	516(3M)	0.0020%	-0.0004%
2/26	515(3M)	0.0020%	-0.0024%

3/6 のコール市場残高(前日比)

合計	214,757	-3,000
有担	127,663	-343
無担	87,094	-2,657

*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	0.072	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.125	-	0.118	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.087	0.125	0.117	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.020	0.084	-	0.018	0.015	0.006	0.007	-	0.030	0.042	0.054

§ 3/10 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.07~0.075%で取引されよう。

共通担保オペはノーオペを予想する。

3/10 の予定(国内)

8:50 2月のマネ・ストック(日銀)

3/10 の予定(海外)

米 1月の卸売在庫

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	+2,300	1,819,300	+1,819,300	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	按分レド	平均レド	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2015/3/9 ~ 2015/6/8	8,000	990	990	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
2015/3/2 ~ 2015/6/1	8,000	2,230	2,230	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
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	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
2015/2/20 ~ 2015/6/2	15,000	11,800	11,800	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
2015/2/17 ~ 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	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2015/2/13 ~ 2015/5/26	15,000	3,860	3,860	0.10%	固定金利	-	札割れ	3/5 ~ 3/12	担保範囲内	2	2	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	2/26 ~ 3/5	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	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