

DAILY SIGNAL

平成27年3月12日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは137兆9,000億円。
無担ON物は朝方0.075%の出会いから始まり、前場は0.07%前半～0.075%で推移した。
後場に入り、調整程度の出合いが散見され引けた。ターム物は1W物が0.11%後半で取引された。本日入札が実施されたTDB(第518回、3M)の入札結果は、最高利回り0.002%、平均利回り▲0.0004%となり、前回債(第516回)と同じ結果となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,379,000	+1,379,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/12 のオペ結果
	3/12(木)		3/13(金)		3/16(月)		3/17(火)		
券	+0		▲400		+1,000		+0		9:20
財政	▲2,000		+5,000		▲8,000		+5,000		ノーオペ
過不足	▲2,000		+4,600		▲7,000		+5,000		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				+4,600					10:40
国庫短期証券買入									社債等買入(3/18-)
国債買現先									0.022%按分(43.6%) 1000億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(3/12-3/13)
CP買現先									▲0.400%全取 11億
CP等買入	▲300		▲200						12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入		+100		+200					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	+300								
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲1,900		+9,200		▲7,000		+5,000		
当座預金残高	1,833,800		1,843,000		1,836,000		1,841,000		
準備預金残高	1,672,000		1,672,000		1,672,000		1,672,000		
積み終了先	1,381,700		1,381,700		1,381,700		1,381,700		
超過準備	1,381,700		1,381,700		1,381,700		1,381,700		
非準備預金残高	161,800		161,800		161,800		161,800		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	89.3%		89.3%		89.3%		89.3%		
乖離率	10.6%		10.6%		10.6%		10.6%		
共通担保オベ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
									共通担保(全店) 65,430
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 46,757
									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
3/13 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 1,400
3/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	3/10
長期国債	142	202	222
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	4.3
J-REIT	0.14	0.18	0.20
貸出支援基金	9.2	25	25
国庫短期証券	40	49	49
その他とも資産計	224	300	321
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	182
その他とも負債・純資産計	224	300	321

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
3/12	518(3M)	0.0020%	-0.0004%
3/6	517(6M)	-0.0019%	-0.0059%
3/5	516(3M)	0.0020%	-0.0004%

3/11 のコール市場残高(前日比)		
合計	226,433	+6,934
有担	130,090	-1,358
無担	96,343	+8,292

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

	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	0.025
ビッド	0.075	0.020	0.105	0.040
出来値	-	-	-	-

3/11 時点のマネタリベース(単位:億円) **2,772,000**

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	0.070	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	0.121	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.078	-	0.117	0.118	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.024	0.025	-	0.015	0.013	▲0.003	0.000	-	0.028	0.042	0.053

§ 3/13 オファターのオペと市場動向予想

週末となる明日の足許金利は0.075%を中心に取引されるだろう。
共通担保オベはノーオペを予想する。

3/13 の予定(国内)

13:30 1月の鉱工業生産確報(経産省)

3/13 の予定(海外)

米 2月の生産者物価
3月のシカゴ大学消費者信頼感速報

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	当増減	当預残高	着地算対比		ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y				
◎	ノーオペ	+9,200	1,843,000	+1,842,500	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										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	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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	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	4,008	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
2015/3/2 ~ 2015/6/1	8,000	2,230	2,230	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ								期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	3/12 ~ 3/19	担保範囲内	2	2	0.630%	固定金利	-	1.00								
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	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																								
2015/2/20 ~ 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																																

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