

DAILY SIGNAL

平成27年3月13日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは139兆円。
積み最終日となる本日の無担ON物0.075%の出会いから始まり、その後は
0.073~0.077%の水準で推移した。後場に入り、一部調整程度の出合いが散見された。
ターム物は1W物が0.11%台後半で取引された。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	1,390,000	+1,389,500

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/13 のオペ結果
	3/13(金)		3/16(月)		3/17(火)		3/18(水)		
券	▲300		+1,200		+0		+0		9:20
財政	+3,500		▲6,800		+5,000		+8,000		ノーオペ
過不足	+3,200		▲5,600		+5,000		+8,000		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	国庫短期証券買入(3/17-)
国債買入	+4,600				+10,000				+0.001%按分(75.4%) 10,002億
国庫短期証券買入									国債買入(3/20-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)									▲0.007%按分(94.1%) 3,003億
共通担保(全店)									(残存3年超5年以下)
CP買現先			▲400						▲0.002%按分(19.7%) 3,501億
CP等買入	▲200		▲400						(残存5年超10年以下)
社債等買入			▲200						+0.011%按分(37.0%) 4,004億
ETF買入									11:50
J-REIT買入		+200		+300					国債補完供給(3/13-3/16)
被災地金融機関支援									▲0.400%全取 91億
貸出									12:50
国債補完供給		▲200	+200						ノーオペ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノーオペ
									13:50
									国債補完供給(3/13-3/16)
									▲0.400%全取 82億
当座預金増減	+7,600		▲5,700		+15,000		▲6,800		
当座預金残高	1,841,400		1,835,700		1,850,700		1,843,900		
準備預金残高	1,678,000		1,678,000		1,678,000		1,678,000		
積み終了先	1,388,200		1,388,200		1,388,200		1,388,200		
超過準備	1,387,700		1,387,700		1,387,700		1,387,700		
非準備預金残高	163,400		163,400		163,400		163,400		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		
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

来 積み期間の所要準備額(積数) 1,971,500

3/16 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 1,971,500

3/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 63,600

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.050	0.072	0.015
ビッド	0.075	0.020	0.105	0.030
出来値	-	-	-	-

3/12 時点のマネタリベース(単位:億円) 2,770,000

(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%

3/12 のコール市場残高(前日比)

	合計	220,004	-6,429
有担	131,143	+1,053	
無担	88,861	-7,482	

*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	0.050	0.075	-	0.070	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.087	-	0.260	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.075	0.077	-	0.114	0.114	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.024	0.035	-	0.015	0.013	▲0.005	▲0.001	-	0.027	0.041	0.053

§ 3/16 オフアのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.07~0.075%の水準で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

3/16 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(17日まで)
17:00 2月の業態別の日銀当座預金残高(日銀)

3/16 の予定(海外)

米 3月のNY連銀製造業景況感指数
2月の鉱工業生産
3月のNAHB住宅市場指数

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	▲5,700	1,835,700	+1,831,173	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
2015/3/9 ~ 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	4,003	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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	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	3/12 ~ 3/19	担保範囲内	2	2	0.630%	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	3/5 ~ 3/12	担保範囲内	2	2	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