

DAILY SIGNAL

平成27年3月23日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは144兆5000億円だった。
本日の無担ON物は0.065%の出合いから始まり、その後も0.06~0.065%を中心に取引された。後場に入ると調整程度の出合いが散見されて引けた。
ターム物は1W物で0.11%台後半の出合いが見られた。

	即日オペ種類	オフア-額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,445,000	+1,445,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/23 のオペ結果
	3/23(月)		3/24(火)		3/25(水)		3/26(木)		
券	▲200		▲1,000		▲1,000		▲1,000		9:20 ノ-オペ 10:10 国債買入(3/25-) (残存1年超3年以下) +0.009%按分(94.6%) 3,002億 (残存3年超5年以下) ▲0.002%按分(88.7%) 3,505億 (残存5年超10年以下) ▲0.023%按分(90.2%) 4,004億 11:50 国債補完供給(3/23-3/24) ▲0.400%全取 35億 12:50 ノ-オペ 13:00 ノ-オペ 13:50 国債補完供給(3/23-3/24) ▲0.400%全取 309億
財政	▲4,600		+3,100		+19,000		+5,000		
過不足	▲4,800		+2,100		+18,000		+4,000		
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		+8,700				+10,500			
国庫短期証券買入				+15,000					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲1,000	+1,100	▲3,800	+3,900					
CP買現先									
CP等買入	▲200	+5,000	▲300						
社債等買入									
ETF買入				+100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給		▲400		+400					
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+8,400		+17,400		+28,500		+4,000		
当座預金残高	1,921,100		1,938,500		1,967,000		1,971,000		
準備預金残高	1,763,200								
積み終了先	1,415,200								
超過準備	1,414,100								
非準備預金残高	157,900								
準備預金進捗率	96.6%								
平均	25.8%		予想込増減 +17,400		予想込増減 +28,500		予想込増減 +4,000		
乖離率	70.8%		当預見込 1,938,500		当預見込 1,967,000		当預見込 1,971,000		
共通担保(本店)			ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		0
共通担保(全店)									67,427
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) 1,971,500

3/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 66,100

3/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,900

	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	0.065
ビッド	0.065	0.030	0.105	0.075
出来値	-	-	-	-

3/20 時点のマネタリベース(単位:億円) 2,850,300

(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
3/19	520(3M)	0.0080%	0.0020%
3/18	519(1Y)	0.0000%	-0.0019%
3/12	518(3M)	0.0020%	-0.0004%

3/20 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	197,060	+2,220	
	130,390	+3,053	
	66,670	-833	

*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	0.055	0.063	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.065	0.074	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.056	0.093	-	▲0.001	0.000	0.003	0.008	-	0.030	0.041	0.052

§ 3/24 オフア-のオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.065%を中心に取引される
だろう。共通担保オペはノ-オペを予想。

3/24 の予定(国内)

10:00 3月20日現在の営業毎旬報告(日銀)

3/24 の予定(海外)

米 2月CPI
1月FHFA住宅価格指数
2月新築住宅販売件数

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-オペ	+17,400	1,938,500	+1,938,500	0.050	0.040	0.040	0.040	0.070	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	按分レ-ト	平均レ-ト	按分率	倍率	期間	オフア-額	応札額	落札額	按分レ-ト	平均レ-ト	按分率	倍率
2015/3/24 ~ 2015/7/3	15,000	3,900	3,900	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
2015/3/23 ~ 2015/6/22	8,000	1,091	1,091	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
2015/3/20 ~ 2015/6/30	15,000	7,592	7,592	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
2015/3/9 ~ 2015/6/8	8,000	990	990	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
2015/3/2 ~ 2015/6/1	8,000	2,230	2,230	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア-額	応札額	落札額	按分レ-ト	平均レ-ト	按分率	倍率
2015/2/20 ~ 2015/6/2	15,000	11,800	11,800	0.10%	固定金利	-	札割れ	3/19 ~ 3/26	担保範囲内	3	3	0.630%	固定金利	-	1.00
2015/2/17 ~ 2015/5/29	15,000	4,711	4,711	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

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