

DAILY SIGNAL

§ 3/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは145兆8000億円だった。
 本日の無担ON物は0.064%の出合いから始まり、その後も0.06%台前半の
 取引が散見された。後場に入ると調整程度の出合いが見られた。

平成27年3月24日(火)
 上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,458,000	+1,458,000

(単位:億円)

	日銀速報 3/24(火)		日銀予想 3/25(水)		当社需給予想				3/24 のオペ結果
	3/24(火)		3/25(水)		3/26(木)		3/27(金)		9:20
券	▲1,100		▲1,000		▲1,000		▲1,000		ノーオペ
財政	+3,600		+22,100		+5,000		▲1,000		10:10
過不足	+2,500		+21,100		+4,000		▲2,000		ノーオペ
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	10:40
国債買入				+10,700					米ドル資金供給
国庫短期証券買入		+15,000							(3/26-4/2)
国債買現先									利率0.610% 810百万米ドル
共通担保(本店)	▲3,800	+3,900							11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(3/24-3/25)
CP買現先			▲1,800						▲0.400%全取 334億
CP等買入	▲300		▲100						12:50
社債等買入									ノーオペ
ETF買入		+100		+100					13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									13:50
貸出									国債補完供給(3/24-3/25)
国債補完供給	+400	▲500	+500						▲0.400%全取 121億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+17,300		+30,500		+4,000		▲2,000		
当座預金残高	1,938,400		1,968,900		1,972,900		1,970,900		
準備預金残高	1,780,000								共通担保(本店) 0
積み終了先	1,446,500								共通担保(全店) 67,517
超過準備	1,439,300								国債買現先 0
非準備先残高	158,400								CP買現先 0
準備預金進捗率	97.4%								成長基盤強化 46,757
平均	29.0%		予想込増減 +30,500		予想込増減 +4,000		予想込増減 ▲2,000		被災地金融機関支援 3,252
乖離率	68.3%		当預見込 1,968,900		当預見込 1,972,900		当預見込 1,970,900		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,971,500
 3/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 52,200
 3/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,400

	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	0.050
ビッド	0.065	0.030	0.105	0.065
出来値	-	-	-	-

3/23 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,858,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	3/20
長期国債	142	202	217
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	4.4
J-REIT	0.14	0.18	0.20
貸出支援基金	9.2	25	28
国庫短期証券	40	49	50
その他とも資産計	224	300	319
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	191
その他とも負債・純資産計	224	300	319

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%

3/23 のコール市場残高(前日比)

合計	203,090	+6,030
有担	130,657	+267
無担	72,433	+5,763

*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	0.061	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.064	0.068	-	0.065	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.048	0.054	-	0.002	0.003	0.006	0.012	-	0.031	0.042	0.052

§ 3/25 オファターのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.06%台前半で推移しよう。
 共通担保オペはノーオペを予想する。

3/25 の予定(国内)

宮尾日銀審議委員が退任

3/25 の予定(海外)

米 週間MBA住宅ローン申請指数
 2月の耐久財受注

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
◎ ノーオペ	+30,500	1,968,900	+1,968,900	0.030	0.040	0.040	0.040	0.070	0.080	0.110	0.120
				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	按分レート	平均レート	按分率	倍率			期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	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	4,008	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	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	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			3/26 ~ 4/2	担保範囲内	810	810	0.610%	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			3/19 ~ 3/26	担保範囲内	3	3	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