DAILY SIGNAL

平成27年3月26日(木) 上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 3/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは148兆5000億円だった。 本日の無担ON物は0.063%の出合いから始まり、その後も0.06%台前半で出合いが見られた。後場では同水準で調整程度の出合いが 散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
8:00	_	-	1,485,000	+1,485,000

(単位:億円)

	日銀	速報	日銀 [·]	予想		当社需	給予想		3/26 のオペ結果	1		
	3/26	6(木)	3/27	(金)	3/30	0(月)	3/31	(火)	<u>9:20</u>			
券		▲ 2,200		▲ 2,200		+0	ノーオペ					
財政		+3,300		▲ 1,900		+11,000	<u>10:10</u> ノーオペ					
過不足		+1,100		▲ 4,100		+11,000		+7,300	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	<u>10:40</u>			
国債買入				+10,600					CP等買入(3/3	31–)		
国庫短期証券買入									0.032%按分(80.0%	5) 5,989億		
国債買現先									11:50			
共通担保(本店)									国債補完供給(3/2	26-3/27)		
共通担保(全店)									▲0.400%全取	105億		
CP買現先												
CP等買入	▲ 500		▲ 1,100					+6,000	12:50			
社債等買入									ノーオペ			
ETF買入				+100					13:00			
J-REIT買入									<u>13:00</u> ノーオペ			
被災地金融機関支援									_			
貸出												
国債補完供給	+100	▲100	+100									
成長基盤強化支援												
貸出増加支援												
24												
当座預金増減		+600		+5,600		+11,000		+13,300				
当座預金残高		1,969,300		1,974,900		1,985,900		1,999,200				
準備預金残高		1,814,100			共通担保才	ペ当社予想			共通担保(本店)	0		
積み終了先		1,479,800	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)	67,517		
超過準備		1,478,400							国債買現先	0		
非準預先残高		155,200							CP買現先	0		
準備預金進捗率		98.2%							成長基盤強化	46,757		
平均			予想込増減		予想込増減	+11,000	予想込増減	+13,300	被災地金融機関支援	3,252		
乖離率		62.7%	当預見込	1,974,900	当預見込	1,985,900	当預見込	1,999,200	ロンバート残高	0		

今 積み期間の所要準備額(積数)

3/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 35,000 3/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均)

1,700

1,971,300

	T,	/N	T+2				
	無担	ユーロ円	CP現先 レポG				
オファー	0.120	0.050	0.072	0.065			
ビッド	0.063	0.030	0.105	0.085			
出来值	-	-	-	-			

3/25 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,908,600

(参	<u>考)日銀B/S(単位:兆円)</u>	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
70	の他とも負債・純資産計	224	300	319

T-Billの入札結果(直近3回)

		最高利回	
		0.0320%	
		0.0080%	
3/18	519(1Y)	0.0000%	-0.0019%

3/25 のコール市場残高(前日比)										
合計	203,016	+687								
有担	128,638	-51								
無担	74.378	+738								

*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	0.062	-	0.030	-	-	-	-	-	_	-
最高	0.130	0.120	_	0.120	-	_	-	_	_	_	-
加重平均	0.065	0.082	0.280	0.053	-	-	-	-	0.117	_	-
東京レポ・レート	0.054	0.096	-	0.015	0.017	0.018	0.020	-	0.031	0.043	0.054

3/27 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.06~0.065%のレンジで推移しよう。 共通担保オペはノーオペを予想する。

3/27 の予定(国内) 8:30 2月全国CPI(総務省) 2月完全失業率(総務省) 2月有効求人倍率(厚労省)

3/27 の予定(海外)

10-12月のGDP(3次速報) ミシカン大学消費者マイント、指数(確報値) FRB副議長の講演(フランクフルト)

	翌営業日の即日オペ予想							翌営業日	の出合いし	ンジ予想			
即	日才ペ金額	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
0	ノーオペ	+5,600	1,974,900	+1,974,900	0.030	0.030	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 ~ 2013	2/6/13	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 ~ 2013	2/6/15	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 ~ 201	12/5/1	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 ~ 2013	2/3/26	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	給才^	°.						
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	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