

DAILY SIGNAL

平成27年3月10日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは137兆4,000億円。
無担ON物は朝方0.075%近辺で取引され、その後も同水準で推移した。
後場に入り、0.07%台の出合いが散見され引けた。
ターム物は1W物が0.11%台後半で取引された。また、外為市場ではドル円が一時的に122円台となり、2007年7月以来、7年8ヶ月ぶりの円安水準となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,374,000	+1,374,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/10 のオペ結果
	3/10(火)		3/11(水)		3/12(木)		3/13(金)		
券	+800		+400		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲8,100		+1,300		▲3,000		+6,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲7,300		+1,700		▲3,000		+5,000		10:40 米ドル資金供給 (3/12-3/19) 利率0.630% 2百万米ドル
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	11:50 国債補完供給(3/10-3/11) ▲0.400%全取 259億
国債買入		+10,700							12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入				+10,000					13:00 ノーオペ
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲900		▲700	+5,000					
社債等買入			▲100						
ETF買入		+200		+200					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+400	▲300	▲100	+300					
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+2,800		+16,300		▲3,000		+5,000		
当座預金残高	1,819,800		1,836,100		1,833,100		1,838,100		
準備預金残高	1,662,600		1,370,900		1,370,900		1,370,900		
積み終了先	1,370,900		1,370,900		1,370,900		1,370,900		
超過準備	1,370,900		1,370,900		1,370,900		1,370,900		
非準備預金残高	157,200		157,200		157,200		157,200		
準備預金進捗率	99.8%		99.8%		99.8%		99.8%		
平均	82.1%		82.1%		82.1%		82.1%		
乖離率	17.6%		17.6%		17.6%		17.6%		
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									100

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,777,500

3/11 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 4,100

3/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 800

	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	0.030
ビッド	0.075	0.020	0.105	0.045
出来値	-	-	-	-

3/9 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,754,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	2/28
長期国債	142	202	219
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	4.3
J-REIT	0.14	0.18	0.19
貸出支援基金	9.2	25	25
国庫短期証券	40	49	53
その他とも資産計	224	300	320
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	185
その他とも負債・純資産計	224	300	320

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
3/6	517(6M)	-0.0019%	-0.0059%
3/5	516(3M)	0.0020%	-0.0004%
2/26	515(3M)	0.0020%	-0.0024%

3/9 のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
219,245	130,957	88,288
+4,488	+3,294	+1,194

*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	0.070	-	0.075	0.118	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.125	-	0.120	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.082	0.125	0.098	0.149	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.038	0.034	-	0.015	0.015	0.002	0.003	-	0.028	0.042	0.053

§ 3/11 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は引き続き0.07%台で取引されよう。
共通担保オペは期落ちがないためノーオペを予想する。

3/11 の予定(国内)

8:50 2月の企業物価指数(日銀)
1月の機械受注(内閣府)

3/11 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
FRBが大手銀ストレイト結果公表

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
◎ ノーオペ	+16,300	1,836,100	+1,836,100	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
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
2015/3/2 ~ 2015/6/1	8,000	2,230	2,230	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ						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		
2015/2/20 ~ 2015/6/2	15,000	11,800	11,800	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	3/5 ~ 3/12	担保範囲内	2	2	0.620%	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																
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