

DAILY SIGNAL

§ 3/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは186兆3,000億円だった。
無担保コールON物は1日を通して▲0.01～0.001%のレンジで取引された。ターム物は1W物で0%近辺の出会いが見られた。

平成28年3月2日(水)
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	-	-	1,863,000	+1,863,000

(単位:億円)

日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/2 のオペ結果	
3/2(水)		3/3(木)		3/4(金)		3/7(月)			
券	+100		▲300		+0		+1,000		9:20 ノーオペ
財政	▲52,300		▲2,700		+6,000		+2,000		10:10 国債買入(3/4-)
過不足	▲52,200		▲3,000		+6,000		+3,000		(1年以下)
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	0.115%按分(53.9%) 701億 (5年超10年以下)
国債買入	+13,400				+5,200				0.01%按分(96.6%) 4,508億
国庫短期証券買入									11:50 国債補完供給(3/2-3/3)
国債買現先							▲500		▲0.500%全取 1億
共通担保(本店)									12:50 ノーオペ
共通担保(全店)			▲100						13:00 ノーオペ
CP買現先	▲400								
CP等買入									
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+200				▲2,000		+7,100		▲100
成長基盤強化支援貸出増加支援									+100
当座預金増減	▲39,000		▲3,100		+16,300		+2,500		
当座預金残高	2,553,700		2,550,600		2,566,900		2,569,400		
準備預金残高	2,300,300				共通担保オペ当社予想				
積み終了先	1,862,100		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(本店) 0
超過準備	1,862,000								共通担保(全店) 57,569
非準備預金残高	253,400								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	55.2%		予想込増減 ▲3,100		予想込増減 +16,300		予想込増減 +10,500		成長基盤強化 58,339
乖離率	44.7%		当預見込 2,550,600		当預見込 2,566,900		当預見込 2,577,400		被災地金融機関支援 3,144
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,917,300
3/3 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,300
3/3 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.000	-	0.0001	-0.020
ビッド	-	-	0.005	-0.005
出来値	-	-	-	-

3/1 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,591,000

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	2/29
長期国債	202	282	299
CP等	2.2	2.2	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	7.5
J-REIT	0.18	0.27	0.29
貸出支援基金	25	31	31
国庫短期証券	49	43	47
その他とも資産計	300	383	404
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	259
その他とも負債・純資産計	300	383	404

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
2/25	591(3M)	-0.1002%	-0.1066%
2/18	590(3M)	-0.1022%	-0.1090%
2/17	589(1Y)	-0.1501%	-0.1601%

3/1 のコール市場残高(前日比)

合計	51,478	-2,007
有担	16,209	+92
無担	35,269	-2,099

*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	-0.040	0.000	-	-0.010	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.050	-	0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.002	0.005	-	-0.001	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.010	-0.005	-	-0.019	-0.021	-0.046	-0.100	-	-0.126	-0.159	-0.169

§ 3/3 オペのオペと市場動向予想

明日の足許金利は、引き続き▲0.01～+0.001%
で取引されるだろう。共通担保オペは期落ちをロール
すると予想。

3/3 の予定(国内)

8:50 3月の当座預金増減要因見込み(日銀)

3/3 の予定(海外)

米 2月のISM非製造業指数

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
◎ ノーオペ	▲3,100	2,550,600	+2,550,600	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050
				～	～	～	～	～	～	～
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

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		
2016/2/29 ～ 2016/5/30	8,000	740	740	0.00%	固定金利	-	札割れ			2015/11/18 ～ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ		
2016/2/22 ～ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	0.00%	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		
2016/2/15 ～ 2016/5/16	8,000	0	0	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		
2016/2/8 ～ 2016/5/9	8,000	0	0	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		
2016/2/1 ～ 2016/5/2	8,000	375	375	0.10%	固定金利	-	札割れ			米ドル資金供給オペ									
2016/1/25 ～ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	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		
2016/1/22 ～ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	0.10%	固定金利	-	札割れ			3/3 ～ 3/10	担保範囲内	10	10	0.880%	固定金利	-	1.00		
2016/1/19 ～ 2016/4/28	15,000	6,193	6,193	0.10%	固定金利	-	札割れ			2/25 ～ 3/3	担保範囲内	1	1	0.870%	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