

DAILY SIGNAL

平成28年3月3日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/3 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは187兆円だった。
無担保コールON物は朝方0%を中心に取引された。その後、一部ネガティブレートの取引も散見され、後場にかけて0%から0.001%の取引が見られて引けた。ターム物は3Wで0%近辺の取引が散見された。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,870,000	+1,870,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/3 のオペ結果
	3/3(木)		3/4(金)		3/7(月)		3/8(火)		
券	▲100		▲200		+1,000		+1,000		9:20 ノオペ 11:50 国債補完供給(3/3-3/4) ▲0.500%全取 135億 12:50 ノオペ 13:00 共通担保(全店)〈固定金利〉 (3/7-6/6) 0%(全取) 190億円 13:10 国債補完供給(3/3-3/4) ▲0.500%全取 5億
財政	▲3,800		+2,800		+2,000		+1,000		
過不足	▲3,900		+2,600		+3,000		+2,000		
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				+5,500					
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)					▲500	+200			
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲600						
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		▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援			▲3,400	+7,100	▲100	+100			
当座預金増減	▲4,100		+11,400		+2,700		+2,000		
当座預金残高	2,549,600		2,561,000		2,563,700		2,565,700		
準備預金残高	2,305,000								
積み終了先	1,867,200								
超過準備	1,867,200								
非準備預金残高	244,600								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	58.6%		予想込増減		+11,400	予想込増減	+2,700	予想込増減	+2,000
乖離率	41.3%		当預見込		2,561,000	当預見込	2,563,700	当預見込	2,565,700
			ノオペ		ノオペ		ノオペ		共通担保(本店) 0
									共通担保(全店) 57,569
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 58,339
									被災地金融機関支援 3,144
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,917,300
3/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,700
3/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

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

3/2 時点のマナターベース(単位:億円) 3,551,900

(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
3/3	592(3M)	-0.0902%	-0.1018%
2/25	591(3M)	-0.1002%	-0.1066%
2/18	590(3M)	-0.1022%	-0.1090%

3/2 のコール市場残高(前日比)		
合計	56,176	+4,698
有担	16,422	+213
無担	39,754	+4,485

*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	0.001	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.002	0.001	-	-0.005	0.000	-	0.000	-	-	-	-
東京レボレート	-0.010	-0.015	-	-0.020	-0.025	-0.050	-0.100	-	-0.130	-0.159	-0.169

§ 3/4 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~+0.01%
で取引されるだろう。共通担保オペはノオペ予想。

3/4 の予定(国内)

10:30 1月の毎月勤労統計速報(厚労省)

3/4 の予定(海外)

米 2月の雇用統計
1月の貿易収支

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	+11,400	2,561,000	+2,561,000	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.080	-0.080
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.001	0.001	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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/3/7 ~ 2016/6/6	8,000	190	190	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				
2016/2/29 ~ 2016/5/30	8,000	740	740	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				
2016/2/22 ~ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	0.00%	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				
2016/2/15 ~ 2016/5/16	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				
2016/2/8 ~ 2016/5/9	8,000	0	0	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/2/1 ~ 2016/5/2	8,000	375	375	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/1/25 ~ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	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				
2016/1/22 ~ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	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