

DAILY SIGNAL

平成28年3月7日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは187兆9,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0%を中心に取引され、
一部ネガティブレートをつけるも、終日0%~0.001%で出合った。
ターム物は1W物で0%近辺の出会いが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,879,000	+1,879,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/7 のオペ結果
	3/7(月)		3/8(火)		3/9(水)		3/10(木)		
券	+1,100		+1,000		+0		+0		9:20
財政	▲4,100		+3,500		+1,000		▲5,000		ノオベ
過不足	▲3,000		+4,500		+1,000		▲5,000		10:10
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	ノオベ
国債買入				+13,700					10:40
国庫短期証券買入				+7,500					CP買入(3/10-)
国債買現先									▲0.198%按分(62.9%) 5,000億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)	▲500	+200							国債補完供給(3/7-3/8)
CP買現先			▲100						▲0.500%全取 107億
CP等買入	▲700							+5,000	12:50
社債等買入									ノオベ
ETF買入				+100					13:00
J-REIT買入									ノオベ
被災地金融機関支援									13:50
貸出									国債補完供給(3/7-3/8)
国債補完供給		▲200	+200						▲0.500%全取 69億
成長基盤強化支援	▲100	+100							
貸出増加支援									
当座預金増減	▲4,200		+25,900		+1,000		+0		
当座預金残高	2,557,500		2,583,400		2,584,400		2,584,400		
準備預金残高	2,317,300								
積み終了先	1,882,300								共通担保(本店) 0
超過準備	1,882,300								共通担保(全店) 57,309
非準備先残高	240,200								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	72.4%		予想込増減	+25,900	予想込増減	+1,000	予想込増減	+0	成長基盤強化 63,410
乖離率	27.5%		当預見込	2,583,400	当預見込	2,584,400	当預見込	2,584,400	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) 1,922,800
3/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 300
3/8以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.001	-0.080
ビッド	-0.001	-0.060
出来値	-	-

3/4 時点のマナターベース(単位:億円) 3,560,000

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

3/4 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	59,517	+87	
有担	15,685	+108	
無担	43,832	-21	

*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	-0.010	0.000	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.001	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.001	0.001	-	0.000	0.000	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.010	-0.050	-	-0.037	-0.042	-0.064	-0.108	-	-0.129	-0.160	-0.170

§ 3/8 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%
のレンジで取引されるだろう。共通担保オペは期落ち
無く、ノオベ予想する。

3/8 の予定(国内)

8:50 10-12月のGDP2次改定値(内閣府)
1月の国際収支(財務省)
14:00 2月の消費動向調査(内閣府)

3/8 の予定(海外)

米 4州で大統領、党员集会
欧 10-12月のGDP確報

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	S6M	S1Y
◎ ノオベ	+25,900	2,583,400	+2,583,400	-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