

DAILY SIGNAL

平成28年3月9日(水)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 3/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは191兆7,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方0%を中心に取引され、
その後も終日0%~0.001%で出合った。
ターム物は1W物で0%近辺の出合いが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,917,000	+1,917,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/9 のオペ結果
	3/9(水)		3/10(木)		3/11(金)		3/14(月)		
券	+400		▲200		+0		+1,000		9:20 ノオペ 10:10 国債買入(3/11-) (5年超10年以下) +0.015%按分(40.0%) 4,500億 (10年超25年以下) +0.090%按分(94.6%) 2,605億 (25年超) +0.051%按分(68.0%) 1,801億 12:50 ノオペ 13:00 ノオペ
財政	+7,700		▲9,900		+5,000		▲2,000		
過不足	+8,100		▲10,100		+5,000		▲1,000		
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									
国庫短期証券買入						+8,900			
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	▲300		▲600	+5,000					
社債等買入			▲100						
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+100								
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+7,900		▲5,800		+13,900		▲1,000		
当座預金残高	2,589,200		2,583,400		2,597,300		2,596,300		
準備預金残高	2,348,500		2,348,500		2,348,500		2,348,500		
積み終了先	1,916,400		1,916,400		1,916,400		1,916,400		
超過準備	1,916,400		1,916,400		1,916,400		1,916,400		
非準備先残高	240,700		240,700		240,700		240,700		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	79.3%		79.3%		79.3%		79.3%		
乖離率	20.6%		20.6%		20.6%		20.6%		
当座預金増減	+7,900		▲5,800		+13,900		▲1,000		
準備預金残高	2,589,200		2,583,400		2,597,300		2,596,300		
準備預金残高	2,348,500		2,348,500		2,348,500		2,348,500		
積み終了先	1,916,400		1,916,400		1,916,400		1,916,400		
超過準備	1,916,400		1,916,400		1,916,400		1,916,400		
非準備先残高	240,700		240,700		240,700		240,700		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	79.3%		79.3%		79.3%		79.3%		
乖離率	20.6%		20.6%		20.6%		20.6%		
共通担保オペ当社予想	ノオペ		ノオペ		ノオペ		ノオペ		
共通担保(本店)	0		0		0		0		
共通担保(全店)	57,309		57,309		57,309		57,309		
国債買現先	0		0		0		0		
CP買現先	0		0		0		0		
成長基盤強化	63,410		63,410		63,410		63,410		
被災地金融機関支援	3,144		3,144		3,144		3,144		
ロンハート残高	0		0		0		0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,922,800
3/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200
3/10 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	-0.100
ビッド	-0.001	-0.080
出来値	-	-

(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	回数	最高利回	平均利回
3/8	593(6M)	-0.1196%	-0.1294%
3/3	592(3M)	-0.0902%	-0.1018%
2/25	591(3M)	-0.1002%	-0.1066%

3/8 のコール市場残高(前日比)		
合計	61,960	+3,154
有担	15,378	-658
無担	46,582	+3,812

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

3/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,577,500**

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	-	-0.010	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.001	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.001	0.001	-	-0.002	0.280	-	0.140	-	-	-	-
東京レポレート	-0.018	-0.069	-	-0.063	-0.068	-0.105	-0.112	-	-0.133	-0.161	-0.171

§ 3/10 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、ノオペ予想する。

3/10 の予定(国内)

8:50 対外対内証券売買契約等の状況(財務省)
2月の企業物価指数(日銀)

3/10 の予定(海外)

米 新規失業保険申請件数
2月の財政収支
欧 ECB理事会、ECB総裁の会見

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	▲5,800	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				
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		
2016/2/29 ~ 2016/5/30	8,000	740	740	0.00%	固定金利	-	札割れ		
2016/2/22 ~ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	0.00%	固定金利	-	札割れ		
2016/2/15 ~ 2016/5/16	8,000	0	0	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2016/2/8 ~ 2016/5/9	8,000	0	0	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2016/2/1 ~ 2016/5/2	8,000	375	375	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2016/1/25 ~ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2016/1/22 ~ 2016/5/2	15,000	6,140	6,140	0.10%	固定金利	-	札割れ		

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		
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	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		
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46		
米ドル資金供給オペ									
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		
3/10 ~ 3/17	担保範囲内	2	2	0.870%	固定金利	-	1.00		
3/3 ~ 3/10	担保範囲内	10	10	0.880%	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