

DAILY SIGNAL

§ 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190兆7,000億円だった。
 本日の無担保コールON物は▲0.01%の割合から始まり、
 その後は終日▲0.01%～0.001%で取引された。
 本日新規でオファーされた共通担保オペは応札がなかった。

平成28年3月10日(木)
 上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残高	所要対比
8:00	-	-	1,907,000	+1,907,000

(単位:億円)

		日銀速報 3/10(木)		日銀予想 3/11(金)		当社需給予想 3/14(月)		当社需給予想 3/15(火)		3/10 のオペ結果	
										9:20	
券		▲100		▲300		+1,000		+0		ノーオペ	
財政		▲10,900		+2,200		▲2,000		▲6,000		10:10	
過不足		▲11,000		+1,900		▲1,000		▲6,000		ノーオペ	
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	
国債買入					+10,000					国債補完供給(3/10-3/11)	
国庫短期証券買入										▲0.500%全取 278億	
国債買現先										12:50	
共通担保(本店)										ノーオペ	
共通担保(全店)										13:00	
CP買現先										共通担保(全店)(固定金利)	
CP等買入		▲600	+5,000	▲1,000						(3/14-6/13)	
社債等買入		▲100		▲100						応札なし	
ETF買入										13:50	
J-REIT買入										国債補完供給(3/10-3/11)	
被災地金融機関支援										▲0.500%全取 45億	
貸出											
国債補完供給			▲300	+300							
成長基盤強化支援											
貸出増加支援											
当座預金増減		▲7,000		+11,100		▲1,000		▲6,000			
当座預金残高		2,582,200		2,593,300		2,592,300		2,586,300			
準備預金残高		2,336,600		2,336,600		2,336,600		2,336,600			
積み終了先		1,903,700		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0	
超過準備		1,903,700		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 57,309	
非準備預金残高		245,600		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先 0	
準備預金進捗率		99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先 0	
平均		82.8%		82.8%		82.8%		82.8%		成長基盤強化 63,410	
乖離率		17.1%		17.1%		17.1%		17.1%		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) 1,922,800
 3/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
 3/11 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	-	0.0001	-0.090
ビッド	-	-	0.005	-0.075
出来値	-	-	-	-

3/9 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,584,900

(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
3/10	594(3M)	-0.0802%	-0.0902%
3/8	593(6M)	-0.1196%	-0.1294%
3/3	592(3M)	-0.0902%	-0.1018%

3/9 のコール市場残高(前日比)

合計	60.834	-1.126
有担	15.105	-273
無担	45.729	-853

*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	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.001	-	0.140	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.003	0.001	-	0.029	-	-	0.140	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.024	-0.086	-	-0.071	-0.076	-0.112	-0.119	-	-0.141	-0.162	-0.174

§ 3/11 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、ノーオペ予想する。

3/11 の予定(国内)

8:50 12月末のデリバティブ取引に関する定例市場報告 (日銀)

3/11 の予定(海外)

米 2月の輸入物価指数

16:00 2月の投信概況(投信協会)

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
◎ ノーオペ	+11,100	2,593,300	+2,593,300	-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)						共通担保資金供給(本店)					
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート
2016/3/14 ～ 2016/6/13	8,000	0	0	0.00%	固定金利	2015/11/18 ～ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%
2016/3/7 ～ 2016/6/6	8,000	190	190	0.00%	固定金利	2012/6/5 ～ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%
2016/2/29 ～ 2016/5/30	8,000	740	740	0.00%	固定金利	2012/6/1 ～ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%
2016/2/22 ～ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	0.00%	固定金利	2012/4/20 ～ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%
2016/2/15 ～ 2016/5/16	8,000	0	0	0.10%	固定金利	米ドル資金供給オペ					
2016/2/8 ～ 2016/5/9	8,000	0	0	0.10%	固定金利	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート
2016/2/1 ～ 2016/5/2	8,000	375	375	0.10%	固定金利	3/10 ～ 3/17	担保範囲内	2	2	0.870%	固定金利
2016/1/25 ～ 2016/4/25	8,000	3,131	3,131	0.10%	固定金利	3/3 ～ 3/10	担保範囲内	10	10	0.880%	固定金利

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