

DAILY SIGNAL

平成28年3月14日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは192兆5,000億円だった。
本日の無担保コールON物は▲0.01%の割合からスタート。
その後は終日▲0.01%~0.001%で取引された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,925,000	+1,925,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/14 のオペ結果
	3/14(月)		3/15(火)		3/16(水)		3/17(木)		
券	+900		+400		+0		▲1,000		9:20
財政	+4,700		▲10,800		+3,000		+3,000		ノオベ
過不足	+5,600		▲10,400		+3,000		+2,000		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				+13,100					12:50
国庫短期証券買入				+12,500					ノオベ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)									ノオベ
共通担保(全店)									13:50
CP買現先									国債補完供給(3/14-3/15)
CP等買入	▲400		▲1,000						▲0.500%全取 392億
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	+200	▲400	+400						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+5,000		+14,500		+3,000		+2,000		
当座預金残高	2,596,700		2,611,200		2,614,200		2,616,200		
準備預金残高	2,356,600		1,925,000		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店) 0
積み終了先	1,925,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 57,309
超過準備	1,925,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0
非準備先残高	240,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0
準備預金進捗率	100.0%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化 63,410
平均	96.6%		予想込増減	+14,500	予想込増減	+3,000	予想込増減	+2,000	被災地金融機関支援 3,144
乖離率	3.4%		当預見込	2,611,200	当預見込	2,614,200	当預見込	2,616,200	ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,922,800
3/15以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
3/15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	-
レボ	-	0.0001
レボ	-	-0.095
レボ	-	0.005
レボ	-	-0.060
出来値	-	-

3/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,587,900**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	3/10
長期国債	202	282	303
CP等	2.2	2.2	2.6
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	32
国庫短期証券	49	43	47
その他とも資産計	300	383	408
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	258
その他とも負債・純資産計	300	383	408

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%

3/11 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	64,264	+1,427	-
有担	14,691	-921	-
無担	49,573	+2,348	-

*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	-0.010	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.002	-0.003	-	-	0.280	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.020	-0.045	-	-0.082	-0.085	-0.128	-0.130	-	-0.143	-0.163	-0.175

§ 3/15 オファーのオペと市場動向予想

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。

3/15 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合の結果
黒田日銀総裁会見
13:30 1月の第3次産業活動(経産省)

3/15 の予定(海外)

米 FOMC(16日まで)
2月小売売上高
2月生産者物価

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	着地残対比		ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノオベ	+5,900	2,597,600	+2,597,600	-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				
2016/3/14 ~ 2016/6/13	8,000	0	0	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				
2016/3/7 ~ 2016/6/6	8,000	190	190	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				
2016/2/29 ~ 2016/5/30	8,000	740	740	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				
2016/2/22 ~ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	0.00%	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				
2016/2/15 ~ 2016/5/16	8,000	0	0	0.10%	固定金利	-	札割れ	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	-	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				
2016/2/1 ~ 2016/5/2	8,000	375	375	0.10%	固定金利	-	札割れ	3/10 ~ 3/17	担保範囲内	2	2	0.870%	固定金利	-	1.00				
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				

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