

DAILY SIGNAL

平成28年3月16日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは193兆6,000億円だった。
積み初日の無担保コールON物は終日▲0.005%~+0.001%で取引された。
本日実施された共通担保資金供給オペでは1兆5000億円のオフアーに対して、
6550億円応札された。

	即日オペ種類	オフアー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,936,000	+1,932,297

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/16 のオペ結果
	3/16(水)		3/17(木)		3/18(金)		3/22(火)		
券	▲600		▲1,200		▲2,000		+0		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(3/18-) (1年超3年以下) ▲0.004%按分(74.9%) 4,001億 (3年超5年以下) ▲0.004%按分(97.0%) 4,204億 (5年超10年以下) ▲0.008%按分(35.1%) 4,503億 11:50 国債補完供給(3/16-3/17) ▲0.500%全取 2,058億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)(固定金利) (3/18-6/28) 0%(全取) 6,550億円 13:50 国債補完供給(3/16-3/17) ▲0.500%全取 28億
財政	+2,000		+3,200		+14,000		+45,000		
過不足	+1,400		+2,000		+12,000		+45,000		
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						+12,700			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)					▲13,200	+6,600	▲11,200		
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲100						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+1,200	▲2,200	+2,200						
成長基盤強化支援貸出増加支援					▲5,500	+23,500			
当座預金増減	▲100		+4,100		+36,100		+33,800		
当座預金残高	2,608,800		2,612,900		2,649,000		2,682,800		
準備預金残高	2,364,200		2,364,200		2,364,200		2,364,200		
積み終了先	848,900		848,900		848,900		848,900		
超過準備	574,500		574,500		574,500		574,500		
非準備先残高	244,600		244,600		244,600		244,600		
準備預金進捗率	66.4%		66.4%		66.4%		66.4%		
平均	3.2%		3.2%		3.2%		3.2%		
乖離率	63.2%		63.2%		63.2%		63.2%		
共通担保オペ当社予想	ノオベ		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
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) 2,047,100
3/17 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 687,400
3/17 以降の残り積み立て額(残り所要)平均) 22,900

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフアー	0.000	-
ビット	-	-
出来値	-	-

3/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,603,800**

(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
国債	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
3/16	595(1Y)	-0.1531%	-0.1641%
3/10	594(3M)	-0.0802%	-0.0902%
3/8	593(6M)	-0.1196%	-0.1294%

3/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
前日比	62,312	+1,918	-566
本日	47,696	+2,484	-

*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	-0.010	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.001	-	0.040	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.002	0.001	-	-0.005	-0.005	-	0.130	-	-	-	-
東京レボレート	-0.029	-0.071	-	-0.085	-0.128	-0.131	-0.125	-	-0.144	-0.163	-0.175

§ 3/17 オフア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分2本(1兆5000億円・8000億円)がロールオフアーされよう。

3/17 の予定(国内)

黒田日銀総裁が決済システムフォーラムで講演
8:50 2月の貿易統計(財務省)
前週の対外及び対内証券売買契約等の状況(財務省)

3/17 の予定(海外)

米 10~12月経常収支
週間新規失業保険申請件数
欧 2月CPI

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
◎ ノオベ	+4,100	2,612,900	+2,612,900	-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	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/3/18 ~ 2016/6/28	15,000	6,550	6,550	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				
2016/3/14 ~ 2016/6/13	8,000	0	0	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				
2016/3/7 ~ 2016/6/6	8,000	190	190	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				
2016/2/29 ~ 2016/5/30	8,000	740	740	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				
2016/2/22 ~ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/2/15 ~ 2016/5/16	8,000	0	0	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/2/8 ~ 2016/5/9	8,000	0	0	0.10%	固定金利	-	札割れ	3/17 ~ 3/24	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	-	応札なし				
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				

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