

DAILY SIGNAL

平成28年3月17日(木)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 3/17 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは194兆1,000億円。
無担保コールON物は▲0.01%～0.001%のレンジで取引された。
タム物は1W物▲0.01～0%近傍の出会い。共通担保資金供給オペが2本実施され、
応札・落札金額は1W物(4/4エンド)4,600億円、3M物(7/1エンド)220億円となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,941,000	+1,941,000

(単位:億円)

		日銀速報 3/17(木)		日銀予想 3/18(金)		当社需給予想 3/22(火)		3/23(水)		3/17 のオペ結果	
						3/22(火)		3/23(水)			
券		▲1,300		▲2,000		+0		+0		9:20 ノーオペ	
財政		+2,300		+7,700		+45,000		+3,000		10:10 ノーオペ	
過不足		+1,000		+5,700		+45,000		+3,000		10:40 CP等買入(3/23-)▲0.385%全取 4,993億円	
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 国債補完供給(3/17-3/18)▲0.500%全取 2,078億円	
国債買入					+13,000					12:50 ノーオペ	
国庫短期証券買入										13:00 共通担保(全店)×(固定金利) (3/22-4/4) 0%(全取) 4,600億円 (3/22-7/1) 0%(全取) 220億円	
国債買現先										13:50 国債補完供給(3/17-3/18) 応札0億円	
共通担保(本店)				▲13,200	+6,600	▲11,200	+4,800				
共通担保(全店)											
CP買現先											
CP等買入		▲100		▲800							
社債等買入				▲900							
ETF買入											
J-REIT買入											
被災地金融機関支援貸出											
国債補完供給		+2,200	▲2,200	+2,200							
成長基盤強化支援貸出増加支援				▲24,400	+23,500						
当座預金増減		+900		+11,700		+38,600		+3,000			
当座預金残高		2,609,700		2,621,400		2,660,000		2,663,000			
準備預金残高		2,364,800				共通担保オペ当社予想				共通担保(本店) 0	
積み終了先		1,797,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) 57,309	
超過準備		1,527,800								国債買現先 0	
非準備預金残高		244,900								CP買現先 0	
準備預金進捗率		86.5%								成長基盤強化 63,410	
平均		6.5%		予想込増減 +11,700		予想込増減 +38,600		予想込増減 +3,000		被災地金融機関支援 3,144	
乖離率		80.1%		当預見込 2,621,400		当預見込 2,660,000		当預見込 2,663,000		ロンバード残高 0	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,047,100
3/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 276,200
3/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 9,500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.000	-	0.0001	-0.060
ビッド	-	-	0.005	-0.040
出来値	-	-	-	-

3/16 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,604,300

(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
3/17	596(3M)	-0.0973%	-0.1025%
3/16	595(1Y)	-0.1531%	-0.1641%
3/10	594(3M)	-0.0802%	-0.0902%

3/16 のコール市場残高(前日比)		
合計	47,374	-14,938
有担	13,841	-775
無担	33,533	-14,163

*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	-0.015	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-0.001	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.003	0.000	-	-0.005	-0.013	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.038	-0.082	-	-0.084	-0.135	-0.130	-0.125	-	-0.144	-0.163	-0.176

§ 3/18 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は、▲0.01～+0.001%のレンジで推移しよう。
共通担保オペはオファー見送りを予想する。

3/18 の予定(国内)

8:50 日銀金融政策決定会合議事要旨
(1月28・29日分)

3/18 の予定(海外)

米 3月のミガン大消費者信頼感指数
NY連銀連銀総裁講演
ボストン連銀総裁講演

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
◎ ノーオペ	+11,700	2,621,400	+2,621,400	-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
2016/3/22 ～ 2016/7/1	15,000	220	220	0.00%	固定金利	2015/11/18 ～ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%
2016/3/22 ～ 2016/4/4	8,000	4,600	4,600	0.00%	固定金利	2012/6/5 ～ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%
2016/3/18 ～ 2016/6/28	15,000	6,550	6,550	0.00%	固定金利	2012/6/1 ～ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%
2016/3/14 ～ 2016/6/13	8,000	0	0	0.00%	固定金利	2012/4/20 ～ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%
2016/3/7 ～ 2016/6/6	8,000	190	190	0.00%	固定金利	米ドル資金供給オペ					
2016/2/29 ～ 2016/5/30	8,000	740	740	0.00%	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
2016/2/22 ～ 2016/5/23	8,000	2,270	2,270	0.00%	固定金利	3/17 ～ 3/24	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利
2016/2/15 ～ 2016/5/16	8,000	0	0	0.10%	固定金利	3/10 ～ 3/17	担保範囲内	2	2	0.870%	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ありません。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