

DAILY SIGNAL

平成28年3月22日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは196兆3,000億円。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.001%の出合から始まり、
その後は▲0.01%~0.001%のレンジで取引された。
後場に入ると0.001%で調整の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,963,000	+1,963,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/22 のオペ結果
	3/22(火)		3/23(水)		3/24(木)		3/25(金)		
券	▲100		▲300		▲1,000		▲2,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(3/24-) (1年以下) +0.015%按分(82.7%) 701億 (5年超10年以下) ▲0.015%按分(13.9%) 4,503億 10:40 米ドル資金供給(3/24-3/31) 貸付金利0.880% 0百万米ドル 社債等買入(3/28-) ▲0.251%按分(94.1%) 1,500億 11:50 国債補完供給(3/22-3/23) ▲0.500%全取 1,757億円 12:50 ノオベ 13:50 国債補完供給(3/22-3/23) ▲0.500%全取 39億円
財政	+39,700		+2,400		+4,000		+12,000		
過不足	+39,600		+2,100		+3,000		+10,000		
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				+13,800		+5,200			
国庫短期証券買入				+17,500					
国債買現先		+3,900	▲3,900						
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲11,200	+4,800					▲8,200		
CP買現先									
CP等買入	▲800		▲200	+5,000					
社債等買入	▲300								
ETF買入		+200							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+2,300	▲1,900	+1,900						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+36,600		+36,200		+8,200		+1,800		
当座預金残高	2,655,500		2,691,700		2,699,900		2,701,700		
準備預金残高	2,411,800		2,411,800		2,411,800		2,411,800		
積み終了先	1,943,000		1,943,000		1,943,000		1,943,000		
超過準備	1,943,000		1,943,000		1,943,000		1,943,000		
非準備先残高	243,700		243,700		243,700		243,700		
準備預金進捗率	97.1%		97.1%		97.1%		97.1%		
平均	22.6%		22.6%		22.6%		22.6%		
乖離率	74.6%		74.6%		74.6%		74.6%		
共通担保オベ当社予想			ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +15,000		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							57,309		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							63,410		
被災地金融機関支援							3,144		
ロンハート残高							0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,047,100
3/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 58,500
3/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,400

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.000	-
レボ	-	0.0001
レボ	-	-0.120
レボ	-	0.005
レボ	-	-0.085
出来値	-	-

3/18 時点のマナターベース(単位:億円) **3,617,700**

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

3/18 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	41,225	-6,441	-
有担	12,842	-701	-
無担	28,383	-5,740	-

*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	-	-	-0.001	-	-	0.100	-	-	-	-
最高	0.010	-	-	0.080	-	-	0.130	-	-	-	-
加重平均	-0.003	0.000	-	0.023	0.100	-	0.117	-	-	-	-
東京レボレート	-0.035	-0.060	-	-0.093	-0.141	-0.137	-0.136	-	-0.145	-0.163	-0.176

§ 3/23 オファ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。 10:00 3/20現在の営業毎旬報告(日銀)
共通担保オベは期落ち分(1兆5000億円)がロールオファーされると予想する。

3/23 の予定(国内)

米 週間MBA住宅ローン申請件数

3/23 の予定(海外)

米 週間MBA住宅ローン申請件数
2月新築住宅販売件数

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	+36,200	2,691,700	+2,691,700	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/3/22 ~ 2016/7/1	15,000	220	220	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/3/22 ~ 2016/4/4	8,000	4,600	4,600	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/3/18 ~ 2016/6/28	15,000	6,550	6,550	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/3/14 ~ 2016/6/13	8,000	0	0	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	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
米ドル資金供給オベ						
期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
3/24 ~ 3/31	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	- 札割れなし
3/17 ~ 3/24	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	- 札割れなし

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