

DAILY SIGNAL

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

§ 3/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは200兆9,000億円。
本日の無担保コールON物は▲0.005%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▲0.005%での出合が見られて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,009,000	+2,009,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/28 のオペ結果
	3/28(月)		3/29(火)		3/30(水)		3/31(木)		
券	+0		▲400		▲1,000		+1,000		9:20
財政	+7,000		▲2,700		+17,000		+8,000		ノーオペ
過不足	+7,000		▲3,100		+16,000		+9,000		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	国債買入(3/30-)
国債買入		+12,800				+4,900			(5年超10年以下)
国庫短期証券買入				+10,000					▲0.011%按分(6.4%)4,503億
国債買現先									(物価連動債)
共通担保(本店)			▲2,400	+600					+0.000円按分(20.0%)400億
共通担保(全店)		+700							10:40
CP買現先									CP買入(3/31-)
CP等買入	▲500		▲800						▲0.598%全取 5,304億
社債等買入		+1,500							11:50
ETF買入									国債補完供給(3/28-3/29)
J-REIT買入									▲0.500%全取 1,016億
被災地金融機関支援									12:50
貸出									ノーオペ
国債補完供給	+1,300	▲1,100	+1,100						13:00
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									
当座預金増減	+21,700		+5,400		+20,900		+14,300		
当座預金残高	2,722,100		2,727,500		2,748,400		2,762,700		
準備預金残高	2,460,100		2,004,600		2,748,400		2,762,700		共通担保(本店)
積み終了先	2,002,500		262,000		99.7%		41.9%		共通担保(全店)
超過準備	262,000		99.7%		41.9%		57.7%		国債買現先
非準備先残高	99.7%		41.9%		57.7%				CP買現先
準備預金進捗率	41.9%		57.7%						成長基盤強化
平均	57.7%								被災地金融機関支援
乖離率									ロンバート残高
									0
									57,309
									0
									0
									63,410
									3,144
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,047,500
3/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,700
3/29 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.000	-0.110
ビッド	-0.040	-0.090
出来値	-	-

3/25 時点のマナターベース(単位:億円) **3,702,400**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	3/20
長期国債	202	282	305
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.1
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	48
その他とも資産計	300	383	411
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	262
その他とも負債・純資産計	300	383	411

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
3/24	597(3M)	-0.1002%	-0.1038%
3/17	596(3M)	-0.0973%	-0.1025%
3/16	595(1Y)	-0.1531%	-0.1641%

3/25 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	39,492	-2,553	
有担	11,410	-222	
無担	28,082	-2,331	

*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	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.005	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.007	-0.001	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.075	-0.095	-	-0.155	-0.143	-0.140	-0.139	-	-0.145	-0.163	-0.176

§ 3/29 オファのオペと市場動向予想

足許金利は、▲0.01～+0.001%を中心に推移しよう。
共通担保オペはオファー見送りを予想する。

3/29 の予定(国内)

8:30 2月の有効求人倍率(厚労省)
2月の完全失業率(総務省)

3/29 の予定(海外)

米 1月のS&Pケース・シャー住宅価格指数
3月の消費者信頼感指数
FRB議長講演(NY)

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
◎	ノーオペ	+5,400	2,727,500	+2,727,500	-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
2016/3/29 ~ 2016/7/8	15,000	550	550	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/3/28 ~ 2016/4/11	8,000	680	680	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/3/25 ~ 2016/7/5	15,000	560	560	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

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

米ドル資金供給オペ

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	- 応札なし
3/17 ~ 3/24	担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	- 応札なし

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