

DAILY SIGNAL

§ 3/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは203兆4000億円。
 本日の無担保コールON物は▲0.01%の割合から始まり、
 その後は▲0.02%～0.001%のレンジで取引された。
 後場に入ると調整程度の割合が見られて引けた。

平成28年3月30日(水)
 上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,034,000	+2,034,000

(単位:億円)

	日銀速報 3/30(水)		日銀予想 3/31(木)		当社需給予想				3/30 のオペ結果
	▲200		▲200		4/1(金)		4/4(月)		9:20 ノーオペ
券	+18,800		+10,900		+1,000		+1,000		10:10
財政	+18,600		+10,700		▲5,000		▲6,000		国債買入(4/1-)
過不足	+18,600		+10,700		▲4,000		▲5,000		(1年超3年以下)
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	▲0.008%按分(89.8%) 4,004億
国債買入		+5,100				+12,200			(3年超5年以下)
国庫短期証券買入									▲0.006%按分(16.4%) 4,203億
国債買現先									(10年超25年以下)
共通担保(本店)					▲1,100		▲5,900		▲0.014%按分(25.3%) 2,409億
共通担保(全店)									(25年超)
CP買現先									▲0.045%按分(79.2%) 1,601億
CP等買入	▲600		▲8,100	+5,300					11:50
社債等買入									国債補完供給(3/30-3/31)
ETF買入									▲0.500%全取 1,109億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									12:50
貸出									ノーオペ
国債補完供給	+1,000	▲1,200	+1,200						13:00
成長基盤強化支援									共通担保(全店)〈固定金利〉
貸出増加支援									(4/1-7/12)
									応札なし
当座預金増減	+22,900		+9,100		+7,100		▲10,900		
当座預金残高	2,748,300		2,757,400		2,764,500		2,753,600		
準備預金残高	2,485,800								共通担保(本店)
積み終了先	2,037,000								共通担保(全店)
超過準備	2,036,700								国債買現先
非準備先残高	262,500								CP買現先
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化
平均	48.4%		予想込増減		+9,100		予想込増減		63,410
乖離率	51.5%		当預見込		2,757,400		当預見込		被災地金融機関支援
									3,144
									ロンバート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,048,000
 3/31 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,800
 3/31 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	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	-0.100
ビッド	-0.010	-	0.005	-0.085
出来値	-	-	-	-

3/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,727,800

(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%

3/29 のコール市場残高(前日比)

合計	39,747	+1,530
有担	11,104	-255
無担	28,643	+1,785

*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	-0.025	-	-	0.000	-0.030	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.300	-0.010	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.007	0.000	-	0.006	-0.014	-	-0.025	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.088	-0.092	-	-0.116	-0.116	-0.118	-0.122	-	-0.145	-0.161	-0.174

§ 3/31 オペのオペと市場動向予想

足許金利は、▲0.02～0.001%のレンジで推移しよう。
 共通担保オペは期落ち分のうち1本(8000億円)がロール
 オペらさるよう。

3/31 の予定(国内)

14:00 2月の住宅着工件数(国交省)
 19:30 3月の日銀当座預金増減要因と金融調節実績速報

3/31 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
 核安全保障サミット(安倍首相が出席)
 日韓首脳会談(ワシントン)

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
◎ ノーオペ	+9,100	2,757,400	+2,757,400	-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)								*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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率					
2016/4/1 ~ 2016/7/12		15,000	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	2012/6/5 ~ 2012/6/13		10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24					
2016/3/29 ~ 2016/7/8		15,000	550	550	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	2012/4/20 ~ 2012/5/1		4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46					
2016/3/28 ~ 2016/4/11		8,000	680	680	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ								期間		オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率						
2016/3/25 ~ 2016/7/5		15,000	560	560	0.00%	固定金利	-	札割れ									3/31 ~ 4/7		担保範囲内	101	101	0.860%	固定金利	-	1.00						
2016/3/22 ~ 2016/7/1		15,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ									3/24 ~ 3/31		担保範囲内	0	0	0.880%	固定金利	-	応れない						
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																							

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