

DAILY SIGNAL

平成28年4月6日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは206兆8,000億円。
無担保コールON物は朝方▲0.015%の出会いから始まった。
その後は▲0.015~0%のレンジで取引され、そのまま引けた。
ターム物は1W物で▲0.015%~0%のレンジで出会いが見られた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,068,000	+2,068,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/6 のオペ結果
	4/6(水)		4/7(木)		4/8(金)		4/11(月)		
券	+1,000		+200		▲1,000		+1,000		9:20
財政	+3,600		▲22,500		+2,000		▲31,000		ノーオペ
過不足	+4,600		▲22,300		+1,000		▲30,000		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(4/8-)
国債買入		+13,200				+12,400			(1年超3年以下)
国庫短期証券買入									▲0.019%按分(11.8%) 3,505億
国債買現先									(3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.010%按分(75.5%) 4,408億
共通担保(全店)									(5年超10年以下)
CP買現先									▲0.008%按分(99.3%) 4,506億
CP等買入	▲100		▲300						10:40
社債等買入									CP買入(4/11-)
ETF買入									▲0.045%按分(28.6%) 2,500億
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(4/6-4/7)
貸出									▲0.500%全取 755億
国債補完供給	+1,000	▲800	+800						12:50
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									13:00
									ノーオペ
									13:50
									国債補完供給(4/6-4/7)
									▲0.500%全取 10億
当座預金増減	+17,900		▲21,800		+13,400		▲29,000		
当座預金残高	2,778,900		2,757,100		2,770,500		2,741,500		
準備預金残高	2,505,900		2,505,800		2,505,800		2,505,800		
積み終了先	2,057,800		2,057,800		2,057,800		2,057,800		
超過準備	2,057,800		2,057,800		2,057,800		2,057,800		
非準備先残高	273,000		273,000		273,000		273,000		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	71.0%		71.0%		71.0%		71.0%		
乖離率	28.9%		28.9%		28.9%		28.9%		
共通担保オベ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店) +8,000		共通担保(本店) 0
									共通担保(全店) 58,409
									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
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,057,100
4/7以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200
4/7以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.010	-0.105
ビッド	-	-0.090
出来値	-	-

4/5 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,761,400

(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
4/6	599(6M)	-0.1574%	-0.1713%
4/5	598(3M)	-0.0850%	-0.0949%
3/24	597(3M)	-0.1002%	-0.1038%

4/5 のコール市場残高(前日比)			
合計	40,861	+1,180	
有担	10,313	-403	
無担	30,548	+1,583	

*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	-0.015	-0.015	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.010	-	-0.117	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.007	-0.013	-	0.017	-	-	-0.040	-	-	-	-
東京レボレート	-0.089	-0.088	-	-0.105	-0.106	-0.110	-0.121	-	-0.140	-0.160	-0.172

§ 4/7 オフア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。
共通担保オベは期落ち分のうち1本(8000億円)がローラ
オフアされよう。

4/7 の予定(国内)

日銀支店長会議(黒田総裁挨拶)
10:00 3月31日現在の営業毎旬報告(日銀)
14:00 地域経済報告[さくらレポート](日銀)

4/7 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
FRB議長と歴代FRB議長のディスカッション(NY)
欧 3月のECB理事会の議事要旨

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	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	▲21,800	2,757,100	+2,757,100	-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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/4/4 ~ 2016/4/18	8,000	1,950	1,950	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
2016/4/1 ~ 2016/7/12	15,000	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
2016/3/29 ~ 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
2016/3/28 ~ 2016/4/11	8,000	680	680	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
2016/3/25 ~ 2016/7/5	15,000	560	560	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オベ							
2016/3/22 ~ 2016/7/1	15,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/3/22 ~ 2016/4/4	8,000	4,600	4,600	0.00%	固定金利	-	札割れ	4/7 ~ 4/14	担保範囲内	0	0	0.860%	固定金利	-	応札なし
2016/3/18 ~ 2016/6/28	15,000	6,550	6,550	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

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