

DAILY SIGNAL

平成28年4月11日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/11 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは203兆5,000億円。
無担ON物は朝方▲0.01%の出会いから始まり、その後▲0.01~0.001%のレンジで推移した。
本日、日銀はマクロ加算残高の算出に用いる基準比率(2016年4月~5月積み期に適用)を2.5%と公表した。

	即日オペ種類	オフ額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,035,000	+2,035,000
2:50				

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/11 のオペ結果
	4/11(月)		4/12(火)		4/13(水)		4/14(木)		
券	+1,600		+700		+0		+0		9:20
財政	▲31,300		+2,000		+0		▲2,000		ノオベ
過不足	▲29,700		+2,700		+0		▲2,000		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	ノオベ
国債買入				+5,400					11:50
国庫短期証券買入				+17,500					国債補完供給(4/11-4/12)
国債買現先									▲0.500%全取 633億
共通担保(本店)	▲1,500	+600							12:50
共通担保(全店)									ノオベ
CP買現先			▲300						13:00
CP等買入	▲400	+2,500							ノオベ
社債等買入									
ETF買入				+300					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+1,300	▲700	+700						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲27,900		+26,300		+0		▲2,000		
当座預金残高	2,746,000		2,772,300		2,772,300		2,770,300		
準備預金残高	2,479,200		2,034,200		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店) 0
積み終了先	2,034,200		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 58,409
超過準備	2,034,200		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0
非準備先残高	266,800		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化 63,410
平均	87.1%		87.1%		87.1%		87.1%		被災地金融機関支援 3,144
乖離率	12.8%		12.8%		12.8%		12.8%		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,072,100
4/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
4/12 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	-0.010	-	0.0001	-0.070
ビッド	-	-	0.005	-0.060
出来値	-	-	-	-

4/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,772,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	3/31
長期国債	202	282	302
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	7.6
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	405
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	275
その他とも負債・純資産計	300	383	405

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
4/7	600(3M)	-0.1082%	-0.1214%
4/6	599(6M)	-0.1574%	-0.1713%
4/5	598(3M)	-0.0850%	-0.0949%

4/8 のコール市場残高(前日比)

	合計	44,292	+3,543
有担	10,063	-153	
無担	34,229	+3,696	

*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	-	-0.015	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.006	-0.012	-	-0.012	-	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.087	-0.065	-	-0.105	-0.111	-0.120	-0.134	-	-0.154	-0.170	-0.185

§ 4/12 オフター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。
共通担保オペの実施は見送りか。

4/12 の予定(国内)

10:00 日銀営業毎旬報告(4月10日現在)
17:00 日本銀行が保有する国債の銘柄別残高
日本銀行による国庫短期証券の銘柄別買入額

4/12 の予定(海外)

フィラデルフィア連銀総裁講演
サンフランシスコ連銀総裁講演
リッチモンド連銀総裁講演

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	S6M	S1Y
◎ ノオベ	+26,300	2,772,300	+2,772,300	-0.050	-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	オフ額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフ額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/4/11 ~ 2016/4/25	8,000	580	580	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				
2016/4/4 ~ 2016/4/18	8,000	1,950	1,950	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				
2016/4/1 ~ 2016/7/12	15,000	0	0	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				
2016/3/29 ~ 2016/7/8	15,000	550	550	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				
2016/3/28 ~ 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											
2016/3/25 ~ 2016/7/5	15,000	560	560	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オフ額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/3/22 ~ 2016/7/1	15,000	220	220	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				
2016/3/22 ~ 2016/4/4	8,000	4,600	4,600	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