

DAILY SIGNAL

§ 4/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは205兆円。
無担ON物は朝方▲0.01%の出会いから始まり、
その後は▲0.01～0.001%のレンジで推移して、引けた。

平成28年4月12日(火)
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	-	-	2,050,000	+2,050,000

(単位:億円)

	日銀速報 4/12(火)		日銀予想 4/13(水)		当社需給予想				4/12 のオペ結果
					4/14(木)		4/15(金)		
券	+800		+400		+0		▲1,000		9:20
財政	+1,700		▲500		▲2,000		+70,000		ノーオペ
過不足	+2,500		▲100		▲2,000		+69,000		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	ノーオペ
国債買入		+5,400							10:40
国庫短期証券買入		+17,500							米ドル資金供給(4/14-4/21)
国債買現先									貸付金利0.86% 0百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(4/12-4/13)
CP買現先	▲300		▲300						▲0.500%全取 915億
CP等買入									
社債等買入									12:50
ETF買入		+300							ノーオペ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:50
国債補完供給	+700	▲1,000	+1,000						国債補完供給(4/12-4/13)
成長基盤強化支援									▲0.500%全取 1億
貸出増加支援									
当座預金増減	+25,100		+600		▲2,000		+69,000		
当座預金残高	2,771,100		2,771,700		2,769,700		2,838,700		
準備預金残高	2,498,100								
積み終了先	2,053,900								共通担保(本店) 0
超過準備	2,053,900								共通担保(全店) 58,409
非準備先残高	273,000								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.3%								CP買現先 0
平均	90.3%		予想込増減 +600		予想込増減 ▲2,000		予想込増減 +69,000		成長基盤強化 63,410
乖離率	9.6%		当預見込 2,771,700		当預見込 2,769,700		当預見込 2,838,700		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) 2,072,100
4/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
4/13 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
オファー	-0.010	-	0.0001	-0.105
ビッド	-	-	0.005	-0.080
出来値	-	-	-	-

4/11 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,743,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	4/10
長期国債	202	282	306
CP等	2.2	2.2	1.8
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	409
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	277
その他とも負債・純資産計	300	383	409

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%

4/11 のコール市場残高(前日比)			
合計	45,585	+1,293	
有担	10,690	+627	
無担	34,895	+666	

*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	-0.030	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.005	-0.015	-	-0.022	-0.030	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.083	-0.076	-	-0.108	-0.112	-0.125	-0.139	-	-0.154	-0.172	-0.186

§ 4/13 オファ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られると予想する。

4/13 の予定(国内)

10:30 原田日銀審議委員挨拶(山口県)

4/13 の予定(海外)

米 ベージュブック
MBA住宅ローン申請指数
3月のPPI

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
◎ ノーオペ	+600	2,771,700	+2,771,700	-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		
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		
2016/3/22 ～ 2016/7/1	15,000	220	220	0.00%	固定金利	-	札割れ			4/14 ～ 4/21	担保範囲内	0	0	0.860%	固定金利	-	応れなし		
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