

DAILY SIGNAL

平成28年4月13日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは205兆9,000億円。
無担ON物は朝方▲0.01%の出しから始まり、
その後は▲0.01~0.001%のレンジで推移して、引けた。
ターム物は1W物で▲0.005%の出しが見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,059,000	+2,059,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/13 のオペ結果
	4/13(水)		4/14(木)		4/15(金)		4/18(月)		
券	+400		▲800		▲1,000		+0		9:20 ノーオペ 10:10 国債買入 (1年超3年以下) +0.002%按分(90.3%) 3,508億 (3年超5年以下) +0.007%按分(79.7%) 4,405億 (5年超10年以下) +0.006%按分(99.1%) 4,508億 11:50 国債補完供給(4/13~4/14) ▲0.500%全取 888億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
財政	▲400		+1,700		+70,000		▲4,000		
過不足	+0		+900		+69,000		▲4,000		
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									
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲3,300		
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲300						
社債等買入									
ETF買入				+200					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+1,000	▲1,000	+1,000						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲300		+1,800		+69,000		▲7,300		
当座預金残高	2,770,800		2,772,600		2,841,600		2,834,300		
準備預金残高	2,496,500		2,496,500		2,496,500		2,496,500		
積み終了先	2,053,400		2,053,400		2,053,400		2,053,400		
超過準備	2,053,400		2,053,400		2,053,400		2,053,400		
非準備預金残高	274,300		274,300		274,300		274,300		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	93.5%		93.5%		93.5%		93.5%		
乖離率	6.4%		6.4%		6.4%		6.4%		
共通担保オベ当社予想	ノ-オペ		ノ-オペ		ノ-オペ		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) 2,072,100
4/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
4/14 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	-0.100
ビッド	-	-0.085
出来値	-	-

4/12 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,767,800**

(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	回号	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%

4/12 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
前日比	46,776	10,132	36,644
変化	+1,191	-558	+1,749

*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	-0.015	-	-0.030	-	-	-0.020	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.001	-	-	0.225	-	-	-	-
加重平均	-0.010	-0.002	-0.015	-0.018	0.030	-	-0.008	-	-	-	-
東京レポレート	-0.084	-0.089	-	-0.108	-0.113	-0.128	-0.143	-	-0.157	-0.179	-0.188

§ 4/14 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。
T+2スタートの共通担保オベがオファーされると予想する。

4/14 の予定(国内)

8:50 2月のマネタリーサーベイ(日銀)

4/14 の予定(海外)

米 G20財務省・中銀総裁会議(ワシントン、15日まで)
3月のCPI、新規失業保険申請件数
黒田日銀総裁が講演(コロンビア大学)

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出しレンジ予想								
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	+1,800	2,772,600	+2,772,600	-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	オファー額	応札額	落札額	按分率	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	オファー額	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	4/14 ~ 4/21	担保範囲内	0	0	0.860%	固定金利	-	札割れなし
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	-	札割れなし

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