

DAILY SIGNAL

平成28年4月15日(金)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

S 4/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは211兆円。
積み最終日となる本日、無担ON物は朝方▲0.01%の出会いから始まり、
その後は▲0.03~0.001%のレンジで推移して、引けた。
ターム物は1W物で▲0.005%の出会いが見られた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	着地残対比
8:00	-	-	2,110,000	+2,110,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/15 のオペ結果
	4/15(金)		4/18(月)		4/19(火)		4/20(水)		
券	▲700		+800		+0		▲1,000		9:20
財政	+70,200		▲9,100		+3,000		▲14,000		ノーオペ
過不足	+69,500		▲8,300		+3,000		▲15,000		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	国庫短期証券買入(4/19-)
国債買入	+12,700				+11,900				▲0.001%按分(92.1%) 10,001億
国庫短期証券買入					+10,000				国債買入(4/19-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲3,300		+3,200				+0.003%按分(68.7%) 3,504億
共通担保(全店)			▲100						(残存3年超5年以下)
CP買現先									▲0.004%按分(61.0%) 4,407億
CP等買入	▲500								(残存10年超25年以下)
社債等買入									▲0.003%按分(82.7%) 2,207億
ETF買入									(残存25年超)
J-REIT買入									▲0.018%按分(57.9%) 1,802億
被災地金融機関支援貸出									10:40
国債補完供給	+600		+600						CP等買入(4/14-4/14)
成長基盤強化支援貸出増加支援	▲600								▲0.024%按分(13.0%) 2,990億
当座預金増減	+82,000		▲7,800		+24,900		▲12,000		11:50
当座預金残高	2,851,900		2,844,100		2,869,000		2,857,000		国債補完供給(4/15-4/18)
準備預金残高	2,571,000								▲0.500%全取 549億
積み終了先	2,110,600								12:50
超過準備	2,110,600								ノーオペ
非準備先残高	280,900								13:00
準備預金進捗率	100.0%								ノーオペ
平均	100.0%		予想込増減 ▲7,800		予想込増減 +24,900		予想込増減 ▲12,000		共通担保(本店)
乖離率	0.0%		当預見込 2,844,100		当預見込 2,869,000		当預見込 2,857,000		共通担保(全店) 58,409

来積み期間の所要準備額(積数) 2,037,700
4/18以降の残り積み立て額(残り所要)積数 190,300
4/18以降の残り積み立て額(残り所要)平均 6,800

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	-0.030	-	0.0001	-0.095
ビッド	-	-	0.005	-0.080
出来値	-	-	-	-

4/14時点のマナターベース(単位:億円) 3,767,000

(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
4/14	601(3M)	-0.1447%	-0.1689%
4/7	600(3M)	-0.1082%	-0.1214%
4/6	599(6M)	-0.1574%	-0.1713%

4/14のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	45,370	-87	-377
	10,065	-	-
	35,305	+290	-

*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	-0.060	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.030	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.010	-0.054	-0.060	-0.050	0.200	-0.050	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.082	-0.077	-	-0.108	-0.116	-0.128	-0.143	-	-0.160	-0.179	-0.188

S 4/18 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.06%近辺での推移か。
共通担保オペは見送られると予想する。

4/18 の予定(国内)

17:00 業態別の日銀当座預金残高(3月)

4/18 の予定(海外)

米 4月NAHB住宅市場指数
NY・ミネアポリス・ボストン連銀総裁講演

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
◎	ノーオペ	▲7,800	2,844,100	+2,844,100	-0.085	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-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)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/4/18 ~ 2016/5/2	8,000	3,210	3,210	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/4/11 ~ 2016/4/25	8,000	580	580	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/4/4 ~ 2016/4/18	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/4/1 ~ 2016/7/12	15,000	0	0	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/3/29 ~ 2016/7/8	15,000	550	550	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/3/28 ~ 2016/4/11	8,000	680	680	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/3/25 ~ 2016/7/5	15,000	560	560	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/3/22 ~ 2016/7/1	15,000	220	220	0.00%	固定金利	- 札割れ

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
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%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%

米ドル資金供給オペ

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
4/14 ~ 4/21		0	0	0.860%	固定金利	- 札割れなし
4/7 ~ 4/14		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