

DAILY SIGNAL

平成28年4月18日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは210兆7,000億円だった。
積み初日となる無担ON物は朝方▲0.08%の出会いから始まった。
その後は一部0%近辺の出会いも見られたが、中心は▲0.08～▲0.07%で推移した。
本日より一部業態によるマイナス金利放出が開始された結果、先週末対比で大幅にレートが低下する地合いとなった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,107,000	+2,107,000

	日銀速報 4/18(月)		日銀予想 4/19(火)		当社需給予想				4/18 のオペ結果
	4/20(水)	4/21(木)	4/20(水)	4/21(木)	4/20(水)		4/21(木)		
券	+600		▲1,000		▲1,000		▲2,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(4/20-) (残存5年超10年以下) ▲0.017%按分(72.5%) 4,505億 (変動利付債) +0.250円按分(26.8%) 1,004億 11:50 国債補完供給(4/18-4/19) ▲0.500%全取 9億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲9,600		+4,800		▲14,000		▲21,000		
過不足	▲9,000		+3,800		▲15,000		▲23,000		
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				+12,800		+5,500			
国庫短期証券買入				+10,000					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲3,300	+3,200							
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲200			+3,000			
社債等買入			▲200						
ETF買入		+100		+300					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+600								
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲8,500		+26,500		▲6,500		▲23,000		
当座預金残高	2,843,400		2,869,900		2,863,400		2,840,400		
準備預金残高	2,556,800		2,039,700		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	2,039,700		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	2,000,700		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備先残高	286,600		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	95.4%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	10.0%		予想込増減	+26,500	予想込増減	▲6,500	予想込増減	▲23,000	
乖離率	85.4%		当預見込	2,869,900	当預見込	2,863,400	当預見込	2,840,400	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,037.700
4/19 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 94.100
4/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 3.500

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オフア	-0.050	-0.130
ビッド	-	-0.095
出来値	-	-

4/15 時点のマナターベース(単位:億円) **3,849,800**

(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
4/18	602(1Y)	-0.2045%	-0.2155%
4/14	601(3M)	-0.1447%	-0.1689%
4/7	600(3M)	-0.1082%	-0.1214%

4/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
30.905	-14.465	-3.002	-11.463
7,063			
23,842			

*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	-0.086	-0.080	-	-0.070	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.010	-0.050	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.074	-0.075	-	-0.055	-0.055	-0.065	-0.060	-	-	-	-
東京レボレート	-0.084	-0.093	-	-0.110	-0.118	-0.128	-0.146	-	-0.161	-0.180	-0.190

§ 4/19 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.08～▲0.07%で推移しよう。
共通担保オペは期落ちなく見送られると予想する。

4/19 の予定(国内)

なし

4/19 の予定(海外)

米 3月の住宅着工件数
ユーロ圏 2月の経常収支

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	+26,500	2,869,900	+2,869,900	-0.085	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080	-0.080
				0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	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
2016/4/18 ~ 2016/5/2	8,000	3,210	3,210	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
2016/4/11 ~ 2016/4/25	8,000	580	580	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
2016/4/4 ~ 2016/4/18	8,000	1,950	1,950	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
2016/4/1 ~ 2016/7/12	15,000	0	0	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
2016/3/29 ~ 2016/7/8	15,000	550	550	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/3/28 ~ 2016/4/11	8,000	680	680	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
2016/3/25 ~ 2016/7/5	15,000	560	560	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	-	応札なし
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

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なく、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