

DAILY SIGNAL

平成28年4月19日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/19 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは212兆3,000億円だった。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.086%の出会いから始まった。
昨日に引き続き、中心レートは▲0.08～▲0.07%で推移したが、
一部で▲0.01%での出会いも見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,123,000	+2,123,000

(単位:億円)

	日銀速報 4/19(火)		日銀予想 4/20(水)		当社需給予想 4/21(木)		4/22(金)		4/19 のオペ結果
券	▲1,100		▲1,300		▲2,000		▲3,000		9:20 ノーオペ
財政	+4,400		▲25,100		▲21,000		▲10,000		10:40 米ドル資金供給(4/21-4/28) 貸付金利0.86% 0百万米ドル
過不足	+3,300		▲26,400		▲23,000		▲13,000		
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		+5,800					11:50 国債補完供給(4/19-4/20) ▲0.600%全取 1億
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)									
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲500	+3,000					
社債等買入	▲200								
ETF買入									
J-REIT買入		+300							
被災地金融機関支援 貸出								+1,100	
国債補完供給									
成長基盤強化支援 貸出増加支援									
当座預金増減	+26,000		▲18,100		▲23,000		▲11,900		
当座預金残高	2,869,400		2,851,300		2,828,300		2,816,400		
準備預金残高	2,574,500		2,574,500		2,574,500		2,574,500		
積み終了先	2,088,200		2,088,200		2,088,200		2,088,200		
超過準備	2,078,000		2,078,000		2,078,000		2,078,000		
非準備先残高	294,900		294,900		294,900		294,900		
準備預金進捗率	97.2%		97.2%		97.2%		97.2%		
平均	13.3%		13.3%		13.3%		13.3%		
乖離率	83.9%		83.9%		83.9%		83.9%		
共通担保オペ当社予想	ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		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
予想込増減	▲18,100		▲23,000		▲11,900		▲11,900		
当預見込	2,851,300		2,828,300		2,816,400		2,816,400		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,037,700
4/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 56,500
4/20 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.080	-	0.0000	-0.105
ビッド	-	-	0.003	-0.095
出来値	-	-	-	-

4/18 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,840,700

(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%

4/18 のコール市場残高(前日比)			
合計	39,243	+8,338	
有担	12,689	+5,626	
無担	26,554	+2,712	

*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	-	-0.050	-	-	-	-	-	-	-
最高	-0.010	0.000	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.078	-0.072	-	-0.037	-	-	-0.070	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.091	-0.095	-	-0.117	-0.132	-0.140	-0.155	-	-0.166	-0.183	-0.193

§ 4/20 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.085～▲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。

4/20 の予定(国内)

8:50 15年度と3月の貿易統計(財務省)

4/20 の予定(海外)

米 3月の中古住宅販売件数

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	▲18,100	2,851,300	+2,851,300	-0.085	-0.080	-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)						共通担保資金供給(本店)					
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート
2016/4/18 ～ 2016/5/2	8,000	3,210	3,210	0.00%	固定金利	2015/11/18 ～ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%
2016/4/11 ～ 2016/4/25	8,000	580	580	0.00%	固定金利	2012/6/5 ～ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%
2016/4/4 ～ 2016/4/18	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	2012/6/1 ～ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%
2016/4/1 ～ 2016/7/12	15,000	0	0	0.00%	固定金利	2012/4/20 ～ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%
2016/3/29 ～ 2016/7/8	15,000	550	550	0.00%	固定金利	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	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート
2016/3/25 ～ 2016/7/5	15,000	560	560	0.00%	固定金利	4/21 ～ 4/28	担保範囲内	0	0	0.860%	固定金利
2016/3/22 ～ 2016/7/1	15,000	220	220	0.00%	固定金利	4/14 ～ 4/21	担保範囲内	0	0	0.860%	固定金利

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