

DAILY SIGNAL

平成28年4月21日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは207兆円だった。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.08%の出会いから始まり、
その後も▲0.08%を中心に推移し、一部0%近傍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	-	-	2,070,000	+2,070,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/21 のオペ結果
	4/21(木)		4/22(金)		4/25(月)		4/26(火)		
券	▲2,300		▲2,600		▲2,000		▲3,000		9:20
財政	▲25,300		▲9,100		▲1,000		▲4,000		ノーオペ
過不足	▲27,600		▲11,700		▲3,000		+1,000		11:50
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	国債補完供給(4/21-4/22)
国債買入				+12,600					▲0.600%全取 81億
国庫短期証券買入									12:50
国債買現先									ノーオペ
共通担保(本店)									13:00
共通担保(全店)					▲3,700	+3,230			共通担保(全店)(固定金利)
CP買現先									(4/25-5/9)
CP等買入	▲100		▲500						0%全取 3230億
社債等買入			▲300						13:50
ETF買入		+300							国債補完供給(4/21-4/22)
J-REIT買入									▲0.600%全取 0億
被災地金融機関支援				+1,100					
貸出									
国債補完供給	+700	▲100	+100						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲26,800		+1,300		▲3,470		+2,000		
当座預金残高	2,823,000		2,824,300		2,820,830		2,822,830		
準備預金残高	2,527,500		2,529,400		2,529,400		2,529,400		
積み終了先	2,059,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店)
超過準備	2,058,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
非準備先残高	295,500		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先
準備預金進捗率	98.7%		98.7%		98.7%		98.7%		CP買現先
平均	20.0%		20.0%		20.0%		20.0%		成長基盤強化
乖離率	78.7%		78.7%		78.7%		78.7%		被災地金融機関支援
									ロンハート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,037.700
4/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 27.300
4/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1.100

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.080	-0.110
ビッド	-	-0.095
出来値	-	-

4/20 時点のマナタリーベース(単位:億円) 3,849,600

(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
4/21	603(3M)	-0.1924%	-0.2044%
4/18	602(1Y)	-0.2045%	-0.2155%
4/14	601(3M)	-0.1447%	-0.1689%

4/20 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	40,286	11,248	29,038
	+584	+53	+531

*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	-0.086	-	-0.060	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.000	-0.030	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.081	-0.083	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
東京レポレート	-0.089	-0.092	-	-0.129	-0.141	-0.151	-0.173	-	-0.185	-0.196	-0.204

§ 4/22 オファーのオペと市場動向予想

週末の足許金利は引き続き▲0.086~▲0.07%で推移しよう。共通担保オペはノーオペ予想。

4/22 の予定(国内)

10:00 4月20日現在の営業毎旬報告(日銀)
13:30 2月の第3次産業活動(経産省)

4/22 の予定(海外)

米 4月の製造業PMI速報

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	+1,300	2,824,300	+2,824,300	-0.086	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/4/25 ~ 2016/5/9	8,000	3,230	3,230	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

*当日物

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	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
4/21 ~ 4/28	担保範囲内	0	0	0.860%	固定金利	- 応札なし
4/14 ~ 4/21	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