

DAILY SIGNAL

平成28年4月25日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/25 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは207兆3,000億円。
本日の無担保コールON物は朝方▲0.08%の出合から始まり、その後は▲0.083~▲0.075%のレンジで推移した。
後場に入り、一部▲0.075%での取引が散見され引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,073,000	+2,073,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/25 のオペ結果
	4/25(月)		4/26(火)		4/27(水)		4/28(木)		
券	▲1,200		▲3,000		▲3,000		▲3,000		9:20 ノーオペ
財政	▲100		+8,300		▲1,000		▲10,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲1,300		+5,300		▲4,000		▲13,000		10:40 CP買入(4/28-) ▲0.010%按分(42.4%) 3,990億
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	11:50 国債補完供給(4/25-4/26) ▲0.600%全取 161億
国債買入				+12,900					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入				+15,000					13:00 ノーオペ
国債買現先									13:50 国債補完供給(4/25-4/26) ▲0.600%全取 14億
共通担保(本店)	▲3,700	+3,200					▲6,200		
共通担保(全店)			▲200					+4,000	
CP買現先									
CP等買入	▲500								
社債等買入	▲300			+1,000					
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+400	▲200	+200						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲2,400		+34,200		▲4,000		▲15,200		
当座預金残高	2,820,900		2,855,100		2,851,100		2,835,900		
準備預金残高	2,538,900		2,076,900		2,075,500		282,000		
積み終了先	2,076,900		2,075,500		282,000				
超過準備	2,075,500		282,000						
非準備預金残高	282,000								
準備預金進捗率	99.7%								
平均	33.3%		予想込増減 +34,200		予想込増減 ▲4,000		予想込増減 ▲200		
乖離率	66.3%		当預見込 2,855,100		当預見込 2,851,100		当預見込 2,850,900		
			共通担保オベ当社予想		共通担保(全店) +15,000				共通担保(本店) 0
			ノーオペ		ノーオペ				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
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,037,700
4/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,100
4/26 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.050	-
レボ	-0.075	-
ビッド	-0.075	-
出来値	-	-

4/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,828,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	4/20
長期国債	202	282	308
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	7.7
J-REIT	0.18	0.27	0.30
貸出支援基金	25	31	32
国庫短期証券	49	43	46
その他とも資産計	300	383	410
銀行券	93	98	95
当座預金	178	253	285
その他とも負債・純資産計	300	383	410

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
4/21	603(3M)	-0.1924%	-0.2044%
4/18	602(1Y)	-0.2045%	-0.2155%
4/14	601(3M)	-0.1447%	-0.1689%

4/22 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	50,327	+7,201	-1,621
	12,421	-	-1,621
	37,906	-	+8,822

*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	-	-	-	-0.065	-0.066	-	-	-	-	-
最高	0.000	-	-	-	-0.040	0.000	-	-	-	-	-
加重平均	-0.075	-0.073	-	-0.050	-0.061	-0.048	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.091	-0.099	-	-0.143	-0.155	-0.165	-0.180	-	-0.196	-0.207	-0.215

§ 4/26 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.086~▲0.07%で取引されよう。
共通担保オベは1兆5,000億円のロールオファーを予想する。

4/26 の予定(国内)

特になし

4/26 の予定(海外)

米 FOMC(27日まで)
2月のS&Pケース・シャー住宅価格指数

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出合いレンジ予想								
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	+34,200	2,855,100	+2,855,100	-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)				*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
2016/4/25 ~ 2016/5/9	8,000	3,230	3,230	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
2016/4/18 ~ 2016/5/2	8,000	3,210	3,210	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
2016/4/11 ~ 2016/4/25	8,000	580	580	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
2016/4/4 ~ 2016/4/18	8,000	1,950	1,950	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
2016/4/1 ~ 2016/7/12	15,000	0	0	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/3/29 ~ 2016/7/8	15,000	550	550	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
2016/3/28 ~ 2016/4/11	8,000	680	680	0.00%	固定金利	-	札割れ	4/21 ~ 4/28	担保範囲内	0	0	0.860%	固定金利	-	応札なし
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

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