

DAILY SIGNAL

平成28年4月26日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは210兆3,000億円。
本日の無担保コールON物は昨日からややレートが上昇する展開で、
朝方▲0.065%の合出から始まり、その後▲0.07～▲0.055%で推移した。
後場に入っても地合いに変化は見られず、引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,103,000	+2,103,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/26 のオペ結果
	4/26(火)		4/27(水)		4/28(木)		5/2(月)		
券	▲3,300		▲4,000		▲3,000		▲3,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(4/28-) (残存5年超10年以下) ▲0.013%按分(100.0%) 4,501億 (残存10年超25年以下) ▲0.018%按分(20.4%) 2,203億 (残存25年超) ▲0.050%按分(9.7%) 1,803億 10:40 米ドル資金供給(4/28-5/12) 貸付金利0.85% 0百万米ドル 11:50 国債補完供給(4/26-4/27) ▲0.600%全取 51億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)(固定金利) (4/25-8/9) 0%全取 80億 13:50 国債補完供給(4/26-4/27) ▲0.600%全取 78億 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 ロンハート残高 0
財政	+6,500		▲7,400		▲10,000		▲12,000		
過不足	+3,200		▲11,400		▲13,000		▲15,000		
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		+12,900				+8,500			
国庫短期証券買入		+15,000							
国債買現先					▲6,200		▲9,700		
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先	▲200		▲200						
CP等買入		+1,000				+4,000			
社債等買入									
ETF買入				+600					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+200	▲100	+100						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+32,000		▲10,900		▲6,700		▲24,700		
当座預金残高	2,852,900		2,842,000		2,835,300		2,810,600		
準備預金残高	2,561,100		ノオベ		ノオベ		共通担保オベ当社予想		
積み終了先	2,100,600						共通担保(全店) +15,000		
超過準備	2,100,600						共通担保(全店) +8,000		
非準備先残高	291,800								
準備預金進捗率	99.7%								
平均	36.7%		予想込増減 ▲10,900		予想込増減 ▲6,700		予想込増減 ▲1,700		
乖離率	63.0%		当預見込 2,842,000		当預見込 2,835,300		当預見込 2,833,600		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,037,000
4/27 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 6,200
4/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オフア	-0.065	-	-0.100	-0.145
ビッド	-0.070	-	0.000	-0.100
出来値	-	-	-	-

4/25 時点のマナターベース(単位:億円) 3,827,000

(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%

4/25 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	57,219	+6,892	
	13,674	+1,253	
	43,545	+5,639	

*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	-	-0.060	-	-	-	-
最高	-0.010	-	-	-	0.230	-	0.010	-	-	-	-
加重平均	-0.067	-0.070	-0.065	-	-0.051	-	-0.033	-	-	-	-
東京レボレート	-0.092	-0.093	-	-0.146	-0.154	-0.164	-0.179	-	-0.196	-0.207	-0.214

§ 4/27 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は▲0.086～▲0.05%で取引されよう。
共通担保オベは1兆5,000億円と8,000億円の
2本オフアされると予想する。

4/27 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(28日まで)
8:50 4月上旬の貿易統計(財務省)

4/27 の予定(海外)

米 FOMCの結果
週間のMBA住宅ローン申請指数

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
◎ ノオベ	▲10,900	2,842,000	+2,842,000	-0.086	-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)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/4/28 ~ 2016/8/9	15,000	80	80	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

*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%

米ドル資金供給オベ

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
4/28 ~ 5/12	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	- 応札なし
4/21 ~ 4/28	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