

DAILY SIGNAL

平成28年4月27日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/27 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは208兆9,000億円。
本日の無担保コールON物は昨日と比べレート水準が上昇し、▲0.06%の出合いからスタートした。前場は▲0.086～▲0.04%のレンジで取引された。後場に入り、一部調整程度の出合いが散見され引けた。本日実施されたTDB(604回債、3M物)の最高利回りは▲0.2284%となり、過去最低を更新した。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,089,000	+2,089,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/27 のオペ結果
	4/27(水)		4/28(木)		5/2(月)		5/6(金)		
券	▲4,200		▲4,100		▲3,000		+4,000		9:20
財政	▲9,900		+7,400		▲12,000		▲10,000		ノーオペ
過不足	▲14,100		+3,300		▲15,000		▲6,000		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(4/27-4/28)
国債買入				+9,300					▲0.600%全取 5億
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)			▲6,200	+100	▲9,700	+1,800			13:00
共通担保(全店)									共通担保(全店)(固定金利)
CP買現先									(5/2-5/16)
CP等買入	▲200		▲2,400	+4,000					0%全取 1780億
社債等買入			▲300						(5/2-8/12)
ETF買入									0%全取 50億
J-REIT買入		+600							13:50
被災地金融機関支援貸出									国債補完供給(4/27-4/28)
国債補完供給	+100	▲100	+100						▲0.600%全取 78億
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	▲13,700		+7,900		▲22,900		▲6,000		
当座預金残高	2,839,200		2,847,100		2,824,200		2,818,200		
準備預金残高	2,539,800		2,081,400		共通担保オペ当社予想		共通担保(本店)		0
積み終了先	2,081,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店)
超過準備	2,081,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		0
非準備先残高	299,400		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		国債買現先
準備預金進捗率	99.7%		99.7%		99.7%		99.7%		CP買現先
平均	40.0%		40.0%		40.0%		40.0%		成長基盤強化
乖離率	59.7%		59.7%		59.7%		59.7%		被災地金融機関支援
			予想込増減	+7,900	予想込増減	▲22,900	予想込増減	▲6,000	ローンハート残高
			当預見込	2,847,100	当預見込	2,824,200	当預見込	2,818,200	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,037,000
4/28 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 5,200
4/28 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		
オファー	-0.065	-0.100
レボ	-0.070	0.000
ビッド	-	-0.095
出来値	-	-

4/26 時点のマナタリーベース(単位:億円) 3,862,300

(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
4/27	604(3M)	-0.2284%	-0.2473%
4/21	603(3M)	-0.1924%	-0.2044%
4/18	602(1Y)	-0.2045%	-0.2155%

4/26 のコール市場残高(前日比)

	合計	56,115	-1,104
有担	12,698	-976	
無担	43,417	-128	

*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	-0.060	-	-0.065	-0.065	-	-0.060	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.000	0.200	-	-0.055	-	-	-	-
加重平均	-0.058	-0.039	-	-0.039	-0.047	-	-0.057	-	-	-	-
東京レボレート	-0.092	-0.104	-	-0.149	-0.155	-0.165	-0.178	-	-0.198	-0.209	-0.217

§ 4/28 オファーのオペと市場動向予想

3日積みとなる明日の足許金利は▲0.086～▲0.04%で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

4/28 の予定(国内)

未定 金融政策決定会合の結果
8:30 3月全国・4月都区部CPI(総務省)
3月の完全失業率(総務省)

4/28 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
1~3月GDP速報

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	+7,900	2,847,100	+2,847,100	-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				
2016/5/2 ~ 2016/5/16	8,000	1,780	1,780	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				
2016/5/2 ~ 2016/8/12	15,000	50	50	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				
2016/4/28 ~ 2016/8/9	15,000	80	80	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				
2016/4/25 ~ 2016/5/9	8,000	3,230	3,230	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				
2016/4/18 ~ 2016/5/2	8,000	3,210	3,210	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/4/11 ~ 2016/4/25	8,000	580	580	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				
2016/4/4 ~ 2016/4/18	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	-	札割れ	4/28 ~ 5/12	担保範囲内	0	0	0.850%	固定金利	-	応札なし				
2016/4/1 ~ 2016/7/12	15,000	0	0	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				

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