

# DAILY SIGNAL

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

## § 4/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは210兆2,000億円。  
本日の無担保コールON物は朝方▲0.055%の出会いから始まり、その後は▲0.065～▲0.04%で取引された。後場に入っても地合いに変化は見られず、引けた。  
本日の日銀金融政策決定会合では、金融政策の現状維持が決定された。また、展望レポートでは物価安定の目標達成時期が2017年度中となることが示された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,102,000	+2,102,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/28 のオペ結果
	4/28(木)		5/2(月)		5/6(金)		5/9(月)		
券	▲4,300		▲100		+4,000		+4,000		9:20 ノオベ 11:50 国債補完供給(4/28-5/2) ▲0.600%全取 272億  12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+4,900		▲22,600		▲10,000		▲35,000		
過不足	+600		▲22,700		▲6,000		▲31,000		
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	+9,300								
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲6,200	+100	▲9,700	+1,800			▲3,200		
CP買現先									
CP等買入	▲2,400	+4,000	▲500						
社債等買入	▲300								
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+100	▲300	+300						
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+4,900		▲30,800		▲6,000		▲34,200		
当座預金残高	2,844,100		2,813,300		2,807,300		2,773,100		
準備預金残高	2,545,700								
積み終了先	2,091,600		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店) 0		
超過準備	2,091,300						共通担保(全店) 58,409		
非準備預金残高	298,400						国債買現先 0		
準備預金進捗率	99.9%						CP買現先 0		
平均	53.3%		予想込増減	▲30,800	予想込増減	▲6,000	予想込増減	▲26,200	
乖離率	46.5%		当預見込	2,813,300	当預見込	2,807,300	当預見込	2,781,100	
								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) 2,046.800  
5/2以降の残り積み立て額(残り所要)積数 2,400  
5/2以降の残り積み立て額(残り所要)平均 200

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.065	-
レボ	-0.070	-
ビッド	-	-
出来値	-	-

4/27 時点のマナターベース(単位:億円) **3,852,700**

(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%

4/27 のコール市場残高(前日比)

	合計	53,292	-2,823
有担	11,513	-1,185	
無担	41,779	-1,638	

\*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	-0.078	-	-	-0.070	-	-	-0.020	-	-	-	-
最高	0.000	-	-	-0.050	-	-	0.000	-	-	-	-
加重平均	-0.056	-	-	-0.065	0.010	-	-0.015	-	-	-	-
東京レボレート	-0.087	-0.089	-	-0.149	-0.154	-0.164	-0.179	-	-0.198	-0.210	-0.217

## § 5/2 オファーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は引き続き、▲0.08～▲0.04%で取引されよう。共通担保オペは8000億円オファーされると予想する。

## 5/2 の予定(国内)

14:00 4月の新車販売(自販直)

## 5/2 の予定(海外)

米 4月のISM製造業指数

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
◎ ノオベ	▲30,800	2,813,300	+2,813,300	-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)					*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