

DAILY SIGNAL

平成27年4月2日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/2 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは152兆5000億円だった。
本日の無担ON物は、0.055%の出会いから始まり、
その後は0.05~0.06%のレンジで取引された。後場には調整の出会いが散見され
引けた。ショートタームでは0.12%割れでの出会いが見られた。

	即日オペ種類	オフアー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,525,000	+1,525,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/2 のオペ結果
	4/2(木)		4/3(金)		4/6(月)		4/7(火)		
券	+300		+100		+2,000		+1,000		9:20
財政	▲5,700		+5,700		▲25,000		+4,000		ノーオペ
過不足	▲5,400		+5,800		▲23,000		+5,000		10:10
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	ノーオペ
国債買入				+11,600					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(4/2-4/3)
国債買現先									▲0.400%全取 1億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲2,400	+2,300			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入			▲100						共通担保(全店)(固定金利方式)
社債等買入									(4/6-7/6)
ETF買入									0.10%(札割れ) 2.251億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲5,400		+17,300		▲23,100		+5,000		
当座預金残高	2,011,600		2,028,900		2,005,800		2,010,800		
準備預金残高	1,846,100								
積み終了先	1,522,600								共通担保(本店) 0
超過準備	1,522,600								共通担保(全店) 67,517
非準備預金残高	165,500								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.7%								CP買現先 0
平均	58.1%		予想込増減	+17,300	予想込増減	▲23,100	予想込増減	+5,000	成長基盤強化 46,757
乖離率	41.6%		当預見込	2,028,900	当預見込	2,005,800	当預見込	2,010,800	被災地金融機関支援 3,252
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,974,600
4/3以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,700
4/3以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフアー	0.120	0.050	0.050	0.025
ビッド	0.055	0.030	0.100	0.040
出来値	-	-	-	-

4/1 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,959,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	3/20
長期国債	142	202	217
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	4.4
J-REIT	0.14	0.18	0.20
貸出支援基金	9.2	25	28
国庫短期証券	40	49	50
その他とも資産計	224	300	319
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	191
その他とも負債・純資産計	224	300	319

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
4/2	522(3M)	0.0160%	0.0092%
3/26	521(3M)	0.0320%	0.0164%
3/19	520(3M)	0.0080%	0.0020%

4/1 のコール市場残高(前日比)			
合計	180,412	-12,214	
有担	124,336	-9,162	
無担	56,076	-3,052	

*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	0.010	0.050	-	0.060	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.057	0.058	-	0.065	0.118	0.118	-	0.110	-	-	-
東京レボ・レート	0.023	0.023	-	0.033	0.033	0.033	0.034	-	0.033	0.043	0.052

§ 4/3 オフアーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.05~0.06%のレンジで
取引されるだろう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

4/3 の予定(国内)

特になし

4/3 の予定(海外)

米 3月の雇用統計
ミアホリス連銀総裁の講演

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	+17,300	2,028,900	+2,028,900	0.030	0.060	0.060	0.070	0.075	0.117	0.118	0.130	0.200
				~	~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.125	0.150	0.150	0.170	0.300	

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	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/4/2 ~ 2015/7/6	8,000	2,251	2,251	0.10%	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	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/3/24 ~ 2015/7/3	15,000	3,900	3,900	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/3/23 ~ 2015/6/22	8,000	1,091	1,091	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ					期間	オフアー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率			
2015/3/20 ~ 2015/6/30	15,000	7,592	7,592	0.10%	固定金利	-	札割れ	4/2 ~ 4/9	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし								
2015/3/9 ~ 2015/6/8	8,000	990	990	0.10%	固定金利	-	札割れ	3/26 ~ 4/2	担保範囲内	810	810	0.610%	固定金利	-	1.00								
2015/3/2 ~ 2015/6/1	8,000	2,230	2,230	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2015/2/20 ~ 2015/6/2	15,000	11,800	11,800	0.10%	固定金利	-	札割れ																

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