

DAILY SIGNAL

平成27年4月6日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは151兆5,000億円。
無担ON物は朝方0.05%台前半の取引から始まり、
一部0.06%近辺の取引も散見された。
調達一巡後は0.05%台前半で取引され、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,515,000	+1,515,000

(単位:億円)

	日銀速報 4/6(月)		日銀予想 4/7(火)		当社需給予想				4/6 のオペ結果
					4/8(水)		4/9(木)		9:20 ノーオペ
券	+2,000		+1,400		+1,000		+0		10:10 国債買入(4/8-)
財政	▲29,700		+2,500		▲2,000		▲4,000		(残存1年以下)
過不足	▲27,700		+3,900		▲1,000		▲4,000		▲0.003%按分(24.0%) 702億
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	(残存10年超25年以下)
国債買入				+11,600		+4,500			▲0.023%按分(45.9%) 2,409億
国庫短期証券買入				+20,000					(残存25年超)
国債買現先									▲0.024%按分(80.0%) 1,402億
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲2,400	+2,300							
CP買現先			▲500						
CP等買入	▲400								
社債等買入									
ETF買入				+300					
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	▲28,200		+35,300		+3,500		▲4,000		
当座預金残高	2,000,800		2,036,100		2,039,600		2,035,600		
準備預金残高	1,838,400								
積み終了先	1,516,200		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,515,800								共通担保(全店) 67,368
非準備先残高	162,400								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	71.0%		予想込増減 +35,300		予想込増減 +3,500		予想込増減 ▲4,000		成長基盤強化 46,757
乖離率	28.9%		当預見込 2,036,100		当預見込 2,039,600		当預見込 2,035,600		被災地金融機関支援 3,252
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,974,600
4/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200
4/7 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.100	0.050	0.015
ビッド	0.055	0.030	0.100	0.030
出来値	-	-	-	-

4/3 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,971,000

(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%

4/3 のコール市場残高(前日比)			
合計	195,357	+10,168	
有担	121,844	-2,985	
無担	73,513	+13,153	

*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	-	0.125	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	0.250	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.057	0.059	-	0.146	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.036	0.038	-	0.032	0.033	0.033	0.034	-	0.033	0.043	0.053

§ 4/7 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.05%台の取引が中心となろう。
共通担保オペは見送られると予想する。

4/7 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(1日目)
10:00 3月31日現在の日銀営業毎旬報告
15:00 コール市場残高(3月)

4/7 の予定(海外)

欧 生産者物価指数(2月)
サービス業PMI(3月確報)

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
◎ ノーオペ	+35,300	2,036,100	+2,036,100	0.030	0.060	0.060	0.070	0.075	0.117	0.118
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.125	0.150	0.150

共通担保資金供給(全店)						*当日物					
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額
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
2015/3/24 ~ 2015/7/3	15,000	3,900	3,900	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005
2015/3/23 ~ 2015/6/22	8,000	1,091	1,091	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008
2015/3/20 ~ 2015/6/30	15,000	7,592	7,592	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003
2015/3/9 ~ 2015/6/8	8,000	990	990	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ			
2015/3/2 ~ 2015/6/1	8,000	2,230	2,230	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	0.10%	固定金利	-	札割れ	4/2 ~ 4/9	担保範囲内	0	0
2015/2/20 ~ 2015/6/2	15,000	11,800	11,800	0.10%	固定金利	-	札割れ	3/26 ~ 4/2	担保範囲内	810	810
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	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24	4/2 ~ 4/9	担保範囲内	0	0
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70	3/26 ~ 4/2	担保範囲内	810	810
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46				
2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70				
米ドル資金供給オペ											
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額
4/2 ~ 4/9	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし	3/26 ~ 4/2	担保範囲内	810	810
3/26 ~ 4/2	担保範囲内	810	810	0.610%	固定金利	-	1.00				

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