

DAILY SIGNAL

平成27年4月7日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは155兆1,000億円。
無担ON物は朝方0.05%台前半の取引が中心であった。
その後0.05~0.06%のレンジで推移し、引けとなった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,551,000	+1,551,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/7 のオペ結果
	4/7(火)		4/8(水)		4/9(木)		4/10(金)		
券	+1,600		+1,000		+0		▲1,000		9:20
財政	+3,700		+2,700		▲4,000		▲4,000		ノーオペ
過不足	+5,300		+3,700		▲4,000		▲5,000		10:40
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	米ドル資金供給 (4/9-4/16)
国債買入		+11,600		+4,900					利率0.620% 0百万米ドル
国庫短期証券買入		+20,000							CP等買入(4/10-)
国債買現先									0.080%按分(85.4%) 3,997億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(4/7-4/8)
CP買現先									▲0.400%全取 7億
CP等買入	▲500		▲100						12:50
社債等買入			▲100						ノーオペ
ETF買入		+300		+300					13:00
J-REIT買入									ノーオペ
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	+36,700		+8,700		▲4,000		▲1,000		
当座預金残高	2,037,500		2,046,200		2,042,200		2,041,200		
準備預金残高	1,870,600		1,870,600		1,870,600		1,870,600		
積み立て先	1,549,900		1,549,900		1,549,900		1,549,900		共通担保(本店) 0
超過準備	1,549,900		1,549,900		1,549,900		1,549,900		共通担保(全店) 67,368
非準備先残高	166,900		166,900		166,900		166,900		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先 0
平均	74.2%		74.2%		74.2%		74.2%		成長基盤強化 46,757
乖離率	25.7%		25.7%		25.7%		25.7%		被災地金融機関支援 3,252
			予想込増減	+8,700	予想込増減	▲4,000	予想込増減	▲1,000	ロンハート残高 0
			当預見込	2,046,200	当預見込	2,042,200	当預見込	2,041,200	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,984,900

4/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200

4/8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	0.025
出来値	-	-	-	-

4/6 時点のマネタリベース(単位:億円) 2,940,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	3/31
長期国債	142	202	220
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	4.5
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	323
銀行券	90	93	90
当座預金	107	178	202
その他とも負債・純資産計	224	300	323

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
4/7	523(6M)	0.0000%	-0.0019%
4/2	522(3M)	0.0160%	0.0092%
3/26	521(3M)	0.0320%	0.0164%

4/6 のコール市場残高(前日比)		
合計	195,859	+502
有担	122,848	+1,004
無担	73,011	-502

*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	0.045	0.050	-	0.063	-	-	0.080	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	0.260	-	-	0.185	-	-	-	-
加重平均	0.058	0.061	-	0.112	0.340	-	0.133	0.145	-	-	-
東京レボ・レート	0.028	0.028	-	0.033	0.034	0.035	0.036	-	0.034	0.043	0.053

§ 4/8 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る。
共通担保オペ見送りを予想する。

4/8 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合の結果公表
黒田日銀総裁記者会見

4/8 の予定(海外)

米 MBA住宅ローン申請指数
NY連銀総裁講演
FOMC議事録(3月17・18日分)

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	+8,700	2,046,200	+2,046,200	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										
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
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
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	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
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	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
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	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
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							
2015/4/2 ~ 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	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	0.10%	固定金利	-	札割れ	4/9 ~ 4/16	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし
2015/2/20 ~ 2015/6/2	15,000	11,800	11,800	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

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