

DAILY SIGNAL

平成27年4月10日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/10 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは154兆7,000億円。
無担ON物は朝方0.055%の取引から始まり、その後は0.05%台後半で推移した。
一部0.06%台の出合いも見られ、前場は終了。後場からは0.05%台前半～半ばで取引され引けた。ON物加重平均金利は0.061%(前日対比+0.02%)となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,547,000	+1,547,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/10 のオペ結果
	4/10(金)		4/13(月)		4/14(火)		4/15(水)		
券	+0		+1,400		+1,000		+0		9:20
財政	▲2,300		▲20,400		▲2,000		+54,000		ノーオペ
過不足	▲2,300		▲19,000		▲1,000		+54,000		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	国庫短期証券買入(4/14-)
国債買入									▲0.002%按分(22.2%) 17,502億
国庫短期証券買入									国債買入(4/14-)
国債買現先									(1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲900	+1,000					▲0.008%按分(12.6%) 3,757億
共通担保(全店)									(3年超5年以下)
CP買現先									+0.001%按分(1.1%) 3,756億
CP等買入	▲700	+4,000	▲100						(10年超25年以下)
社債等買入									+0.007%按分(53.6%) 2,406億
ETF買入									(25年超)
J-REIT買入		+100		+200					+0.010%按分(87.5%) 1,403億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給									12:50
成長基盤強化支援									国債補完供給(4/10-4/13)
貸出増加支援									▲0.400%全取 24億
									13:00
									ノーオペ
当座預金増減	+1,100		▲18,800		+27,800		+54,000		
当座預金残高	2,040,100		2,021,300		2,049,100		2,103,100		
準備預金残高	1,861,800								
積み終了先	1,541,200								共通担保(本店)
超過準備	1,541,200								共通担保(全店)
非準備先残高	178,300								国債買現先
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先
平均	90.3%		予想込増減	▲18,800	予想込増減	+27,800	予想込増減	+54,000	成長基盤強化
乖離率	9.6%		当預見込	2,021,300	当預見込	2,049,100	当預見込	2,103,100	被災地金融機関支援
									ロンハート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,984,900

4/13 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 0

4/13 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 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	0.030	0.015
ビッド	0.055	0.030	0.100	0.030
出来値	-	-	-	-

4/9 時点のマネタリベース(単位:億円) 2,976,000

(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	回数	最高利回	平均利回
4/9	524(3M)	0.0040%	0.0032%
4/7	523(6M)	0.0000%	-0.0019%
4/2	522(3M)	0.0160%	0.0092%

4/9 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	198,579	-2,570	
	123,967	-2,049	
	74,612	-521	

*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	0.020	0.051	-	0.053	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.200	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.061	0.061	-	0.093	-	-	0.180	-	0.125	-	-
東京レボレート	0.031	0.044	-	0.035	0.035	0.036	0.036	-	0.034	0.042	0.053

§ 4/13 オファーのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.05~0.06%台での推移か。
共通担保オペのオファーは見送られると予想する。

4/13 の予定(国内)

8:50 金融政策決定会合議事録(3/16・17分)
9:30頃 黒田日銀総裁が支店長会議にて挨拶
14:00 地域経済報告(さくらレポート)

4/13 の予定(海外)

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	▲18,800	2,021,300	+2,021,300	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	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
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	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
2015/4/2 ~ 2015/7/6	8,000	2,251	2,251	0.10%	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	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/3/24 ~ 2015/7/3	15,000	3,900	3,900	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/3/23 ~ 2015/6/22	8,000	1,091	1,091	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	4/9 ~ 4/16	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし
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																
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																

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