

DAILY SIGNAL

平成27年4月13日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは152兆8,000億円。
無担ON物は朝方0.059%の出会いから始まり、その後は0.056~0.06%で取引された。
調達一巡後はビッド水準が低下し、0.05%台前半で推移した。後場に入り、調整程度の
出会いが散見され引けた。本日公表された日銀地域経済報告では、3地域(北陸・東海・近畿)
の景気情勢判断を引き上げ、その他6地域は前回(15年1月)から据え置いた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,528,000	+1,528,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/13 のオペ結果
	4/13(月)		4/14(火)		4/15(水)		4/16(木)		
券	+1,300		+400		+0		▲1,000		9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(4/15-) (残存1以下) +0.001%按分(7.5%) 708億 (残存5年超10年以下) ▲0.010%按分(83.1%) 4,009億 10:40 社債等買入(4/17-) 0.055%按分(51.7%) 750億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
財政	▲20,500		+2,500		+54,000		▲25,000		
過不足	▲19,200		+2,900		+54,000		▲26,000		
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				+11,600		+4,700			
国庫短期証券買入				+17,500					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲900	+1,000							
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲300						
社債等買入									
ETF買入		+200							
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	▲19,000		+31,700		+58,700		▲26,000		
当座預金残高	2,021,100		2,052,800		2,111,500		2,085,500		
準備預金残高	1,845,200		1,845,200		1,845,200		1,845,200		
積み終了先	1,526,600		1,526,600		1,526,600		1,526,600		
超過準備	1,526,600		1,526,600		1,526,600		1,526,600		
非準備預金残高	175,900		175,900		175,900		175,900		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
平均	93.5%		93.5%		93.5%		93.5%		
乖離率	6.5%		6.5%		6.5%		6.5%		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							67,408		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							46,757		
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) 1,984,900

4/14 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 0

4/14 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	0.035
ビッド	0.060	0.030	0.100	0.045
出来値	-	-	-	-

4/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) 2,977,200

(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
4/13	525(2M)	0.0260%	0.0163%
4/9	524(3M)	0.0040%	0.0032%
4/7	523(6M)	0.0000%	-0.0019%

4/10 のコール市場残高(前日比)			
合計	有担	無担	前日比
196,811	126,842	69,969	-1,768
			+2,875
			-4,643

*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	0.055	-	0.076	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.130	-	0.125	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.060	0.059	-	0.082	-	-	-	-	-	0.135	-
東京レボレート	0.019	0.017	-	0.034	0.034	0.035	0.036	-	0.033	0.042	0.053

§ 4/14 オファターのオペと市場動向予想

足許金利は引き続き0.05~0.06%で取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

4/14 の予定(国内)

8:50 2月のマネタリーサーベイ(日銀)
4月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

4/14 の予定(海外)

米 3月の小売売上高
3月の生産者物価指数

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								
◎	ノーオペ	+31,700	2,052,800	+2,052,800	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	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	按分レート	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	4,003	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					期間	オファー額	応札額	落札額 <td>按分レート</td> <td>平均レート</td> <td>按分率</td> <td>倍率</td>	按分レート	平均レート	按分率	倍率			
2015/3/23 ~ 2015/6/22	8,000	1,091	1,091	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	-	札割れ								
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	-	札割れ								
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