

DAILY SIGNAL

平成27年4月15日(水)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは160兆1,000億円。
積み最終日となる本日の無担ON物は朝方0.06%の出会いから始まり、その後も0.06%近辺で推移した。後場に入り、ビッドが薄くなる中、0.05%台後半の出会いが散見され引けた。
ターム物は1~2W物が0.11%台後半で取引された。

(単位: 億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	1,601,000	+1,601,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/15 のオペ結果
	4/15(水)		4/16(木)		4/17(金)		4/20(月)		
券	▲100		▲700		▲2,000		+0		9:20 ノオベ
財政	+58,900		▲26,100		+3,000		▲59,000		10:10 国債買入(4/17-)
過不足	+58,800		▲26,800		+1,000		▲59,000		(残存1年超3年以下)
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3年超5年以下)
国債買入		+4,800				+11,500			+0.002%按分(28.4%) 3,753億
国庫短期証券買入									(残存5年超10年以下)
国債買現先									+0.010%按分(85.2%) 4,006億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(4/15-4/16)
CP買現先									▲0.400%全取 21億
CP等買入	▲300		▲300						12:50
社債等買入									ノオベ
ETF買入		+100		+300		+800			13:00
J-REIT買入									ノオベ
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	+63,400		▲26,800		+13,300		▲59,800		
当座預金残高	2,115,700		2,088,900		2,102,200		2,042,400		
準備預金残高	1,933,800								共通担保(本店) 0
積み終了先	1,601,100	ノオベ	ノオベ	ノオベ	共通担保(全店)	+8,000	共通担保(全店)	67,408	0
超過準備	1,601,100								0
非準備先残高	181,900								0
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		成長基盤強化 46,757
平均	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		被災地金融機関支援 3,252
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		ロンハート残高 0
当座預金増減	+63,400		▲26,800		+13,300		▲59,800		
当座預金残高	2,115,700		2,088,900		2,102,200		2,042,400		
準備預金残高	1,933,800								
積み終了先	1,601,100	ノオベ	ノオベ	ノオベ	共通担保(全店)	+8,000	共通担保(全店)	67,408	0
超過準備	1,601,100								0
非準備先残高	181,900								0
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		成長基盤強化 46,757
平均	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		被災地金融機関支援 3,252
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		ロンハート残高 0

来 積み期間の所要準備額(積数) 1,931,600
4/16以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,931,600
4/16以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 64,400

	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	0.070
ビッド	0.055	0.030	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

4/14 時点のマネタリーベース(単位: 億円) 2,987,800

(参考)日銀B/S(単位: 兆円)	13年末実績	14年末実績	4/10
長期国債	142	202	223
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	4.6
J-REIT	0.14	0.18	0.21
貸出支援基金	9.2	25	28
国庫短期証券	40	49	51
その他とも資産計	224	300	327
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	204
その他とも負債・純資産計	224	300	327

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
4/15	526(1Y)	-0.0019%	-0.0059%
4/13	525(2M)	0.0260%	0.0163%
4/9	524(3M)	0.0040%	0.0032%

4/14 のコール市場残高(前日比)

	201.191	+1,971
合計	201.191	+1,971
有担	127.115	+82
無担	74.076	+1,889

*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	0.056	-	-	0.118	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	-	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.061	0.081	-	0.117	0.121	0.088	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.028	0.067	-	0.039	0.040	0.038	0.038	-	0.033	0.041	0.053

§ 4/16 オファターのオペと市場動向予想

積み初日となる明日の足許金利は、0.055~0.06%で推移しよう。
共通担保オペは8000億円のロールオファーを予想する。

4/16 の予定(国内)

8:50 前週の対外対内証券売買契約等の状況 (財務省)
17:00 業態別の日銀当座預金残高(3月)

4/16 の予定(海外)

米 G20財務相・中央銀行総裁会議(17日まで)
週間の新規失業保険申請件数
3月の住宅着工件数

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
◎ ノオベ	▲26,800	2,088,900	+2,088,900	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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	*当日物		
						按分率	倍率	
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	0.10%	固定金利	-	札割れ	
2015/4/2 ~ 2015/7/6	8,000	2,251	2,251	0.10%	固定金利	-	札割れ	
2015/3/24 ~ 2015/7/3	15,000	3,900	3,900	0.10%	固定金利	-	札割れ	
2015/3/23 ~ 2015/6/22	8,000	1,091	1,091	0.10%	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	
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	

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	*当日物		
						按分率	倍率	
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	
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	按分レド	平均レド	按分率	倍率	
4/16 ~ 4/23	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	札割れなし	
4/9 ~ 4/16	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	札割れなし	

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。 上田八木証券株式会社 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