

DAILY SIGNAL

平成27年4月16日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは157兆7,000億円。
積み初日となる本日のON物は昨日同様、0.06%の出会いから始まり、その後も0.06%近辺で推移した。後場に入ってからレートが低下し、0.055%近辺の取引が散見され引けた。
ターム物は1W物が0.11%台後半で取引された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,577,000	+1,564,772

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/16 のオペ結果
	4/16(木)		4/17(金)		4/20(月)		4/21(火)		
券	▲900		▲1,600		+0		▲1,000		9:20
財政	▲25,900		+5,400		▲59,000		+7,000		ノーオペ
過不足	▲26,800		+3,800		▲59,000		+6,000		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	CP等買入(4/21-)
国債買入				+11,700					0.073%按分(4.4%) 3,994億
国庫短期証券買入									12:50
国債買現先					▲800	+1,300			ノーオペ
共通担保(本店)									13:00
共通担保(全店)									共通担保(全店)(固定金利方式)
CP買現先									(4/20-7/21)
CP等買入	▲300		▲400						0.10%(札割れ) 1,265億
社債等買入				+800					
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	▲26,800		+15,900		▲58,500		+10,000		
当座預金残高	2,088,900		2,104,800		2,046,300		2,056,300		
準備預金残高	1,909,100								
積み終了先	529,700								共通担保(本店) 0
超過準備	388,700								共通担保(全店) 67,408
非準備先残高	179,800								国債買現先 0
準備預金進捗率	61.5%								CP買現先 0
平均	3.3%		予想込増減 +15,900		予想込増減 ▲58,500		予想込増減 +10,000		成長基盤強化 46,757
乖離率	58.2%		当預見込 2,104,800		当預見込 2,046,300		当預見込 2,056,300		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) 1,931,600
4/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 743,800
4/17 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 25,600

	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	0.090
出来値	-	-	-	-

4/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,051,300

(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
4/16	527(3M)	0.0000%	0.0000%
4/15	526(1Y)	-0.0019%	-0.0059%
4/13	525(2M)	0.0260%	0.0163%

4/15 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	198,008	-3,183	
	128,648	+1,533	
	69,360	-4,716	

*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	0.057	-	0.114	-	-	0.118	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	0.155	-	-	0.170	-	-	-	-
加重平均	0.066	0.070	-	0.118	-	-	0.151	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.044	0.068	-	0.039	0.039	0.038	0.038	-	0.034	0.042	0.054

§ 4/17 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.06%を中心に取引されるだろう。
共通担保オペは見送られるだろう。

4/17 の予定(国内)

10:30 2月の毎月動労統計確報(厚労省)
14:00 3月の消費動向調査(内閣府)

4/17 の予定(海外)

米 IMF・世銀春季総会(ワシントン、19日まで)
3月の消費者物価

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	+15,900	2,104,800	+2,104,800	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
2015/4/20 ~ 2015/7/21	8,000	1,265	1,265	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
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	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
2015/4/2 ~ 2015/7/6	8,000	2,251	2,251	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率			
2015/3/24 ~ 2015/7/3	15,000	3,900	3,900	0.10%	固定金利	-	札割れ	4/16 ~ 4/23	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし								
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	-	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																
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																

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