

DAILY SIGNAL

平成27年4月20日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは152兆円。
無担ON物は朝方0.06%近辺で取引され、調達一巡後0.05%台後半で推移した。
その後も地合いに変わらず、引けた。ターム物は1~3W物0.11%台後半の出会い。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,520,000	+1,520,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/20 のオペ結果
	4/20(月)		4/21(火)		4/22(水)		4/23(木)		
券	▲400		▲600		▲2,000		▲3,000		9:20
財政	▲69,500		+6,800		▲13,000		▲4,000		ノオベ
過不足	▲69,900		+6,200		▲15,000		▲7,000		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	ノオベ
国債買入				+8,500					12:50
国庫短期証券買入				+27,500					ノオベ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)	▲800	+1,300							ノオベ
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲100	+4,000					
社債等買入			▲100						
ETF買入									
J-REIT買入		+300		+100					
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	▲69,500		+46,100		▲15,000		▲7,000		
当座預金残高	2,035,800		2,081,900		2,066,900		2,059,900		
準備預金残高	1,855,600								
積み終了先	1,510,900								共通担保(本店) 0
超過準備	1,501,000								共通担保(全店) 67,913
非準備預金残高	180,200								国債買現先 0
準備預金進捗率	97.9%								CP買現先 0
平均	16.7%		予想込増減	+46,100	予想込増減	▲15,000	予想込増減	▲7,000	成長基盤強化 46,757
乖離率	81.3%		当預見込	2,081,900	当預見込	2,066,900	当預見込	2,059,900	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) 1,932,200

4/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 39,900

4/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,600

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.050	0.060	0.075
ビッド	0.055	0.030	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

4/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,043,500

(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%

4/17 のコール市場残高(前日比)

	合計	210,031	+4,401
有担	127,008		+73
無担	83,023		+4,328

*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	-	0.116	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.122	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.062	0.070	-	0.118	0.180	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.053	0.084	-	0.044	0.039	0.038	0.038	-	0.035	0.043	0.053

§ 4/21 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は0.06%近辺で推移しよう。

共通担保オペはオファーされないと予想する。

4/21 の予定(国内)

14:00 3月のスーパー売上高(日本チェーンストア協会)

14:30 3月の全国百貨店売上高(百貨店協会)

4/21 の予定(海外)

特になし

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	+46,100	2,081,900	+2,081,900	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)					*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				
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				
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	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				
2015/4/2 ~ 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				
2015/3/24 ~ 2015/7/3	15,000	3,900	3,900	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				
2015/3/23 ~ 2015/6/22	8,000	1,091	1,091	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2015/3/20 ~ 2015/6/30	15,000	7,592	7,592	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				
2015/3/9 ~ 2015/6/8	8,000	990	990	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				
2015/3/2 ~ 2015/6/1	8,000	2,230	2,230	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				

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