

DAILY SIGNAL

平成27年4月23日(木)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは154兆9000億円だった。
本日の無担ON物は朝方0.061%の取引からスタートし、その後は0.06~0.063%のレンジで推移した。一巡後もビッドは残り、0.06%近辺の取引が散発的に出合った。後場にかけては調整程度の出合いが見られて引けた。
ターム物は1W物で0.11%台後半の出合い。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,549,000	+1,549,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/23 のオペ結果
	4/23(木)		4/24(金)		4/27(月)		4/28(火)		
券	▲2,800		▲2,900		▲3,000		▲3,000		9:20
財政	▲3,300		+15,000		▲12,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲6,100		+12,100		▲15,000		▲2,000		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	ノーオペ
国債買入				+11,700					ノーオペ
国庫短期証券買入									
国債買現先									13:00
共通担保(本店)					▲2,900	+2,600			共通担保(全店)(固定金利方式)
共通担保(全店)									(4/27-7/27)
CP買現先									0.10%(札割れ) 2640億
CP等買入	▲200		▲200						14:00
社債等買入	▲100		▲500						国債補完供給(4/23-4/24)
ETF買入		+200							▲0.400%全取 40億
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	▲6,200		+23,100		▲15,300		▲2,000		
当座預金残高	2,064,100		2,087,200		2,071,900		2,069,900		
準備預金残高	1,880,400								共通担保(本店) 0
積み終了先	1,549,000								共通担保(全店) 67,913
超過準備	1,549,000								国債買現先 0
非準備預金残高	183,700								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.0%								成長基盤強化 46,757
平均	26.7%		予想込増減 +23,100		予想込増減 ▲15,300		予想込増減 ▲2,000		被災地金融機関支援 3,252
乖離率	72.3%		当預見込 2,087,200		当預見込 2,071,900		当預見込 2,069,900		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,932,200
4/24 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 19,500
4/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 900

	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	0.080
ビッド	0.058	0.030	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

4/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,011,700

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	4/20
長期国債	142	202	226
CP等	2.2	2.2	1.9
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	4.7
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	46
その他とも資産計	224	300	325
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	325

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
4/23	528(3M)	-0.0040%	-0.0064%
4/16	527(3M)	0.0000%	0.0000%
4/15	526(1Y)	-0.0019%	-0.0059%

4/22 のコール市場残高(前日比)			
	合計	212,193	-1,269
有担	124,131	-1,869	
無担	88,062	+600	

*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	0.055	0.062	-	-	-	0.114	-	-	-	-	-
最高	0.075	0.130	-	-	-	0.115	-	-	-	-	-
加重平均	0.063	0.071	-	0.117	-	0.114	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.050	0.076	-	0.040	0.038	0.038	0.035	-	0.033	0.042	0.053

§ 4/24 オファーのオペと市場動向予想

週末となる明日の足許金利は0.06~0.065%を中心に取引されよう。共通担保オペはノーオペを予想。

4/24 の予定(国内)

13:30 全産業活動指数(経産省)
未定 中曾日銀副総裁が証券アナリスト協会主催セミナーで講演(都内)

4/24 の予定(海外)

米 3月の耐久財受注

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	+23,100	2,087,200	+2,087,200	0.050	0.065	0.065	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
2015/4/27 ~ 2015/7/27	8,000	2,640	2,640	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
2015/4/20 ~ 2015/7/21	8,000	1,265	1,265	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
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	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			
2015/4/2 ~ 2015/7/6	8,000	2,251	2,251	0.10%	固定金利	-	札割れ	4/23 ~ 4/30	担保範囲内	0	0	0.600%	固定金利	-	応札なし								
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																
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																

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ありません。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