

DAILY SIGNAL

平成27年4月14日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは155兆9,000億円。
無担ON物は朝方0.06%の出会いから始まり、その後は0.05%台後半~0.06%で取引された。
調達一巡後はビッド水準が低下し、0.055%近辺で推移した。後場に入っても地合いに変化は
なく引けた。
ターム物は2W物が0.11%台後半で取引された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,559,000	+1,559,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/14 のオペ結果
	4/14(火)		4/15(水)		4/16(木)		4/17(金)		
券	+400		▲100		▲1,000		▲2,000		9:20 ノーオペ
財政	+2,000		+59,200		▲25,000		+3,000		10:10 ノーオペ
過不足	+2,400		+59,100		▲26,000		+1,000		10:40 ノーオペ
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	10:40 米ドル資金供給 (4/16-4/23) 利率0.620% 0百万米ドル
国債買入		+11,600		+4,800					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入		+17,500							13:00 ノーオペ
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲300						
社債等買入									+800
ETF買入									
J-REIT買入				+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	+31,200		+63,700		▲26,000		+1,800		
当座預金残高	2,052,300		2,116,000		2,090,000		2,091,800		
準備預金残高	1,874,600		1,874,600		1,874,600		1,874,600		
積み終了先	1,555,400		1,555,400		1,555,400		1,555,400		共通担保(本店) 0
超過準備	1,555,300		1,555,300		1,555,300		1,555,300		共通担保(全店) 67,408
非準備先残高	177,700		177,700		177,700		177,700		国債買現先 0
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		CP買現先 0
平均	96.8%		96.8%		96.8%		96.8%		成長基盤強化 46,757
乖離率	3.2%		3.2%		3.2%		3.2%		被災地金融機関支援 3,252
当座預金増減	+31,200		+63,700		▲26,000		+1,800		ロンハート残高 0
準備預金残高	1,874,600		1,874,600		1,874,600		1,874,600		
積み終了先	1,555,400		1,555,400		1,555,400		1,555,400		
超過準備	1,555,300		1,555,300		1,555,300		1,555,300		
非準備先残高	177,700		177,700		177,700		177,700		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
平均	96.8%		96.8%		96.8%		96.8%		
乖離率	3.2%		3.2%		3.2%		3.2%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,984,900

4/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0

4/15 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	0.060
ビッド	0.055	0.030	0.100	0.075
出来値	-	-	-	-

4/13 時点のマネタリベース(単位:億円) 2,956,900

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

4/13 のコール市場残高(前日比)		
合計	199,220	+2,409
有担	127,033	+191
無担	72,187	+2,218

*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	0.056	-	0.065	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.260	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.059	0.065	-	0.112	0.118	-	-	0.150	-	-	-
東京レポレート	0.022	0.063	-	0.037	0.038	0.037	0.037	-	0.033	0.042	0.053

§ 4/15 オファーのオペと市場動向予想

積み最終日となる明日の足許金利は、0.06%近辺で

取引されよう。

共通担保オペはノーオペを予想する。

4/15 の予定(国内)

13:30 2月の鉱工業生産・確報(経産省)

4/15 の予定(海外)

米 ページブック

週間のMBA住宅ローン申請指数

4月のNY連銀製造業景況感指数

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	着地残対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノーオペ	+63,700	2,116,000	+2,116,000	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
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
2015/4/2 ~ 2015/7/6	8,000	2,251	2,251	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
2015/3/24 ~ 2015/7/3	15,000	3,900	3,900	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
2015/3/23 ~ 2015/6/22	8,000	1,091	1,091	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
2015/3/20 ~ 2015/6/30	15,000	7,592	7,592	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/3/9 ~ 2015/6/8	8,000	990	990	0.10%	固定金利	-	札割れ	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
2015/3/2 ~ 2015/6/1	8,000	2,230	2,230	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
2015/2/23 ~ 2015/5/25	8,000	2,451	2,451	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