

DAILY SIGNAL

平成27年5月1日(金)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

5/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは157兆4000億円だった。
6日積みとなる本日の無担ON物は、0.065%の出合いからスタート。
その後は0.06%台後半で取引が進んだ。後場では調整程度の出合いが散見された。
ターム物では1W物で0.11%台後半の出合いが見られた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,574,000	+1,574,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/1 のオペ結果
	5/1(金)		5/7(木)		5/8(金)		5/11(月)		
券									9:20
財政		▲2,600		+3,900		+4,000		+3,000	ノオベ
過不足		▲10,200		▲45,500		▲3,000		+6,000	10:10
金融調節		▲12,800		▲41,600		+1,000		+9,000	国庫短期証券買入(5/8-)
国債買入	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	▲0.017%按分(9.4%) 22,502億
国庫短期証券買入									国債買入(5/8-)
国債買現先									(残存1以下)
共通担保(本店)			▲800	+1,400					+0.004%按分(33.6%) 707億
共通担保(全店)									(残存1年超3年以下)
CP買現先									+0.002%按分(1.2%) 3,757億
CP等買入	▲100		▲400						(残存3年超5年以下)
社債等買入									+0.006%按分(7.7%) 3,752億
ETF買入									11:50
J-REIT買入		+300							国債補完供給(5/1-5/7)
被災地金融機関支援									▲0.400%全取 7億
貸出									12:50
国債補完供給	+100								ノオベ
成長基盤強化支援									13:00
貸出増加支援									ノオベ
当座預金増減		▲12,500		▲41,400		+31,700		+6,800	
当座預金残高		2,089,700		2,048,300		2,080,000		2,086,800	
準備預金残高		1,894,800							
積み終了先		1,572,800							共通担保(本店) 0
超過準備		1,572,700							共通担保(全店) 67,642
非準備預金残高		194,900							国債買現先 0
準備預金進捗率		99.9%							CP買現先 0
平均		71.0%	予想込増減	▲41,400	予想込増減	+31,700	予想込増減	+14,800	成長基盤強化 46,757
乖離率		28.9%	当預見込	2,048,300	当預見込	2,080,000	当預見込	2,094,800	被災地金融機関支援 3,251
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,939,300
5/7以降の残り積み立て額(残り所要)積数 1,700
5/7以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.070	0.060	0.065
ビッド	0.060	0.020	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

4/30時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,058,800

(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
4/28	529(3M)	-0.0020%	-0.0058%
4/23	528(3M)	-0.0040%	-0.0064%
4/16	527(3M)	0.0000%	0.0000%

4/30のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	192,801	-17,671	
	125,343	+1,074	
	67,458	-18,745	

*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	4M	1Y
最低	0.050	0.058	-	0.064	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	0.123	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.068	0.069	-	0.106	0.118	-	-	-	0.117	0.115	-
東京レボレート	0.053	0.063	-	0.039	0.038	0.038	0.037	-	0.033	0.041	0.053

5/7 オフアのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.06%台を中心に取引されるだろう。
共通担保オペはロールオフアを予想する。

5/7 の予定(国内)

8:50 4月のマネタリーベース(日銀)
10:00 4月30日現在の営業毎旬報告(日銀)

5/7 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数

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								
◎ ノオベ	▲41,400	2,048,300	+2,048,300	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	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2015/5/7 ~ 2015/8/3	8,000	1,360	1,360	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
2015/4/27 ~ 2015/7/27	8,000	2,640	2,640	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
2015/4/20 ~ 2015/7/21	8,000	1,265	1,265	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	4/30 ~ 5/14	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応札なし
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																
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																

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