

DAILY SIGNAL

平成27年5月7日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは153兆9000億円だった。
本日の無担ON物は、0.065%の出会いからスタート。
その後も0.06%台半ばの狭いレンジで取引された。
後場に入ると、0.06%台前半の出会いが散見され、引けた。
ターム物では1W物で0.11%台後半の出会いが見られた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,539,000	+1,539,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/7 のオペ結果
	5/7(木)		5/8(金)		5/11(月)		5/12(火)		
券		+4,200		+4,300		+4,000		+3,000	9:20 ノオベ 10:10 国債買入(5/11-) (残存5年超10年以下) +0.050%按分(99.1%) 4,003億 (残存10年超25年以下) +0.038%按分(84.4%) 2,401億 (残存25年超) +0.035%按分(61.4%) 1,401億 11:50 国債補完供給(5/7-5/8) ▲0.400%全取 13億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店×固定金利方式) (5/11-8/10) 0.10%(札割れ) 1,600億
財政		▲46,400		+1,000		+0		▲12,000	
過不足		▲42,200		+5,300		+4,000		▲9,000	
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	
国債買入				+8,200		+7,800			
国庫短期証券買入				+22,500					
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲800	+1,400			▲2,200	+1,600			
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲400						
社債等買入									
ETF買入									
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		▲42,000		+35,600		+11,200		▲9,000	
当座預金残高		2,047,700		2,083,300		2,094,500		2,085,500	
準備預金残高		1,861,700							
積み終了先		1,541,200							
超過準備		1,540,300							
非準備先残高		186,000							
準備預金進捗率		99.9%							
平均		74.2%	予想込増減	+35,600	予想込増減	+11,200	予想込増減	▲9,000	
乖離率		25.7%	当預見込	2,083,300	当預見込	2,094,500	当預見込	2,085,500	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,939,300
5/8以降の残り積み立て額(残り所要)積数 700
5/8以降の残り積み立て額(残り所要)平均 100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.080	0.060	0.050
ビッド	0.060	0.010	0.100	0.065
出来値	-	-	-	-

5/1 時点のマネタリベース(単位:億円) 3,048,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	4/30
長期国債	142	202	230
CP等	2.2	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	4.8
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	50
その他とも資産計	224	300	333
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	210
その他とも負債・純資産計	224	300	333

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%

5/1 のコール市場残高(前日比)		
合計	196,396	+3,595
有担	126,608	+1,265
無担	69,788	+2,330

*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	0.055	0.058	-	0.060	-	-	0.080	-	-	-	-
最高	0.130	0.120	-	0.175	-	-	0.185	-	-	-	-
加重平均	0.065	0.072	-	0.113	0.160	-	0.139	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.051	0.079	-	0.041	0.039	0.038	0.037	-	0.033	0.041	0.053

5/8 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。
共通担保オペはノオベを予想する。

5/8 の予定(国内)

8:50 4/7-8の金融政策決定会合議事要旨(日銀)

5/8 の予定(海外)

米 4月の雇用統計
3月の卸売売上高

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
◎ ノオベ	+35,600	2,083,300	+2,083,300	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				
期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率		
2015/5/11 ~ 2015/8/10	8,000	1,600	1,600	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/5/7 ~ 2015/8/3	8,000	1,360	1,360	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/4/27 ~ 2015/7/27	8,000	2,640	2,640	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/4/20 ~ 2015/7/21	8,000	1,265	1,265	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/4/2 ~ 2015/7/6	8,000	2,251	2,251	0.10%	固定金利	-	札割れ		
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		

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	按分レド	平均レド	按分率	倍率		
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		
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		
米ドル資金供給オペ									
期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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		
4/23 ~ 4/30	担保範囲内	0	0	0.600%	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