

DAILY SIGNAL

5/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは162兆5,000億円。
無担ON物は朝方0.06%台後半の取引から始まりその後も同水準で推移した。
後場からは0.06%近辺の出合いが散見され、引けとなった。

平成27年5月13日(水)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,625,000	+1,625,000

(単位:億円)

	日銀速報 5/13(水)		日銀予想 5/14(木)		当社需給予想 5/15(金) 5/18(月)				5/13 のオペ結果 9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(5/15-) (残存1年以下) +0.004%按分(20.5%) 709億 (残存5年超10年以下) ▲0.006%按分(87.1%) 4,004億 10:40 社債買入(5/19-) 0.032%按分(38.3%) 1,250億 11:50 国債補完供給(5/13-5/14) ▲0.400%(全取) 645億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ
券	+2,000		+1,000		+0		+1,000		
財政	▲1,000		▲38,800		+14,000		▲10,000		
過不足	+1,000		▲37,800		+14,000		▲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		+11,800				+4,700			
国庫短期証券買入		+20,000							
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,800		
CP買現先									
CP等買入	▲500	+3,500	▲200						
社債等買入				+300					
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		▲700	+700						
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+35,100		▲37,000		+18,700		▲10,800		
当座預金残高	2,115,300		2,078,300		2,097,000		2,086,200		
準備預金残高	1,926,600		共通担保オペ当社予想						共通担保(本店) 0
積み終了先	1,616,600		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000	共通担保(全店) 67,672	
超過準備	1,616,500							国債買現先 0	
非準備先残高	188,700							CP買現先 0	
準備預金進捗率	100.0%							成長基盤強化 46,757	
平均	93.5%		予想込増減 ▲37,000		予想込増減 +18,700		予想込増減 ▲2,800		
乖離率	6.5%		当預見込 2,078,300		当預見込 2,097,000		当預見込 2,094,200		
							被災地金融機関支援 3,251		
							ロンバート残高 0		

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,951,300

5/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0

5/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	5/10
長期国債	142	202	230
CP等	2.2	2.2	2.1
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	334
銀行券	90	93	90
当座預金	107	178	208
その他とも負債・純資産計	224	300	334

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
5/12	531(6M)	-0.0060%	-0.0060%
5/8	530(3M)	-0.0020%	-0.0036%
4/28	529(3M)	-0.0020%	-0.0058%

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	0.120	0.080	0.060	0.025
ビッド	0.065	0.010	0.100	0.040
出来値	-	-	-	-

5/12 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,023,800

5/12 のコール市場残高(前日比)			
合計	208,197	+3,344	
有担	127,333	+1,995	
無担	80,864	+1,349	

*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	-	0.062	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.075	0.123	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.068	0.071	-	0.087	0.310	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.019	0.026	-	0.038	0.037	0.037	0.036	-	0.033	0.041	0.053

5/14 オファーのオペと市場動向予想

明日の足許金利は0.06%台後半での推移か。
T+2スタートの共通担保オペがオファーされると予想する。

5/14 の予定(国内)

8:50 4月のマネーストック(日銀)

5/14 の予定(海外)

米 4月のPPI
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
◎ ノーオペ	▲37,000	2,078,300	+2,078,300	0.050	0.065	0.065	0.070	0.075	0.117	0.118
				0.050	0.065	0.065	0.070	0.075	0.117	0.118
				0.125	0.120	0.120	0.120	0.125	0.150	0.150

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
2015/5/11 ~ 2015/8/10	8,000	1,600	1,600	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
2015/5/7 ~ 2015/8/3	8,000	1,360	1,360	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
2015/4/27 ~ 2015/7/27	8,000	2,640	2,640	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ															
2015/4/20 ~ 2015/7/21	8,000	1,265	1,265	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	5/14 ~ 5/21	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応けなし
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	0.10%	固定金利	-	札割れ	4/30 ~ 5/14	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	応けなし								
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																

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