

DAILY SIGNAL

平成27年5月15日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは159兆3,000億円。
無担ON物は朝方0.067%の出会いから始まり、その後0.065~0.07%のレンジで推移した。
後場に入り0.06~0.07%台の取引が散見され、引けにかけて0.05%台が出合った。
ターム物は2W物0.11%台後半の出会い。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	1,593,000	+1,593,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/15 のオペ結果
	5/15(金)		5/18(月)		5/19(火)		5/20(水)		
券	+700		+1,800		+1,000		+0		9:20
財政	+14,600		▲16,000		▲3,000		▲11,000		ノーオペ
過不足	+15,300		▲14,200		▲2,000		▲11,000		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	国庫短期証券買入(5/19-)
国債買入		+4,900				+11,300			+0.002%按分(95.1%) 20,001億
国庫短期証券買入						+20,000			国債買入(5/19-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲1,800	+1,300	▲13,600	+11,300			+0.004%按分(61.5%) 3,756億
共通担保(全店)									(残存3年超5年以下)
CP買現先									▲0.011%按分(23.1%) 3,753億
CP等買入	▲800		▲300						(残存10年超25年以下)
社債等買入						+1,300			▲0.043%按分(68.9%) 2,401億
ETF買入									(残存25年超)
J-REIT買入		+400		+400					▲0.038%按分(70.0%) 1,400億
被災地金融機関支援貸出									11:50
国債補完供給									国債補完供給(5/15-5/18)
成長基盤強化支援貸出増加支援									▲0.040%全取 28億
当座預金増減	+19,800		▲14,600		+28,300		▲11,000		12:50
当座預金残高	2,098,200		2,083,600		2,111,900		2,100,900		ノーオペ
準備預金残高	1,908,700		1,908,700		1,908,700		1,908,700		13:00
積み終了先	1,591,800		1,591,800		1,591,800		1,591,800		共通担保(本店) 0
超過準備	1,591,800		1,591,800		1,591,800		1,591,800		共通担保(全店) 67,672
非準備先残高	189,500		189,500		189,500		189,500		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
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%		0.0%		成長基盤強化 46,757
			予想込増減 ▲14,600		予想込増減 +28,300		予想込増減 ▲11,000		被災地金融機関支援 3,251
			当預見込 2,083,600		当預見込 2,111,900		当預見込 2,100,900		ロンハート残高 0

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,010,600
5/18 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 262,800
5/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 9,100

	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	0.045
ビッド	0.065	0.010	0.100	0.065
出来値	-	-	-	-

5/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,019,000**

(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
5/14	532(3M)	0.0000%	-0.0024%
5/12	531(6M)	-0.0060%	-0.0060%
5/8	530(3M)	-0.0020%	-0.0036%

5/14 のコール市場残高(前日比)

	合計	204,235	-11,602
有担	125,966	-2,895	
無担	78,269	-8,707	

*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	0.050	0.058	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.070	0.072	-	-	0.118	-	0.118	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.035	0.059	-	0.038	0.037	0.037	0.035	-	0.033	0.041	0.053

5/18 オフアのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.06%台後半で推移しよう。
共通担保オペの実施は見送られると予想する。

5/18 の予定(国内)

8:50 マネタリーサーベイ(3月)
3月の機械受注(内閣府)
17:00 業態別の日銀当座預金残高(4月)

5/18 の予定(海外)

特になし

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	
◎	ノーオペ	▲14,600	2,083,600	+2,083,600	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	按分レート	平均レート	按分率	倍率		
2015/5/19 ~ 2015/8/28	15,000	11,251	11,251	0.10%	固定金利	-	札割れ		
2015/5/18 ~ 2015/8/17	8,000	1,331	1,331	0.10%	固定金利	-	札割れ		
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		

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	按分レート	平均レート	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	-	応札なし		
4/30 ~ 5/14	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