

DAILY SIGNAL

平成27年5月18日(月)

上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは158兆円。無担ON物は朝方0.067%の出会いから始まり、その後も0.06%台後半で推移した。後場に入り、一部調整程度のお合いが散見され引けた。ターム物は1W物0.11%台後半のお合い。本日入札が実施されたTDB(1Y、533回)は最高利回り▲0.0069%となり、前回債(1Y、526回、最高利回り▲0.0019%)より低下した。

(単位:億円)

Table with 5 columns: 即日オペ種類, オフター額, 準備残高見込, 所要対比. Row 1: 8:00, -, -, 1,580,000, +1,580,000

Main market data table with columns for 日銀速報, 日銀予想, 当社需給予想, and 5/18 のオペ結果. Includes sub-tables for 準備預金残高 and 共通担保オペ当社予想.

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,010,600
5/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 135,300
5/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 4,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円) table with columns: 13年末実績, 14年末実績, 5/10. Rows include 長期国債, CP等, 社債等, etc.

T-Billの入札結果(直近3回)

Table with 4 columns: 入札日, 回数, 最高利回, 平均利回. Rows for 5/18, 5/14, 5/12.

Table with columns: T/N, T+2. Rows for 無担, ユーロ円, CP現先, レボG.C, オファー, ビッド, 出来値.

5/15 のコール市場残高(前日比) table with columns: 合計, 有担, 無担. Values: 189,607, 126,594, 63,013.

\*出所: 営業毎旬報告
\*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

5/15 時点のマナタリベース(単位:億円) 3,038,200

Table with columns: 無担保コールレート速報, ON, TN, SN, 1W, 2W, 3W, 1M, 2M, 3M, 6M, 1Y. Includes 東京レボ・レート row.

5/19 オフターのオペと市場動向予想

足許金利は引き続き0.06%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペはノオペを予想する。

5/19 の予定(国内)

10:30 3月の毎月動労統計確報(厚労省)

5/19 の予定(海外)

米 4月の住宅着工件数
欧 4月のユーロ圏消費者物価確報

Table with columns: 翌営業日の即日オペ予想, 翌営業日の出会いレンジ予想. Includes rows for 即日オペ金額, ON, S1W, S2W, S3W, S1M, S2M, S3M, S6M, S1Y.

Table with columns: 共通担保資金供給(全店), 翌営業日の即日オペ予想, 共通担保資金供給(本店), 翌営業日の出会いレンジ予想. Includes rows for 期間, オフター額, 応札額, 落札額, etc.

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