

DAILY SIGNAL

平成27年5月20日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは159兆5000億円。
無担ON物は朝方0.069%の出会いから始まり、その後0.068~0.07%で取引された。
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物が0.11%台後半で取引された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	1,595,000	+1,595,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/20 のオペ結果
	5/20(水)		5/21(木)		5/22(金)		5/25(月)		
券	▲300		▲1,200		▲1,000		+1,000		9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(5/22-) (残存1年超3年以下) +0.005%按分(74.8%) 3,752億 (残存3年超5年以下) +0.003%按分(94.2%) 3,754億 (残存10年超25年以下) +0.016%按分(46.8%) 2,404億 (残存25年超) +0.013%按分(64.5%) 1,405億 12:50 ノーオペ 13:00 共通担保(全店)(固定金利方式) (5/22-9/1) 0.10%(札割れ) 7,256億
財政	▲11,800		▲25,700		+1,000		▲10,000		
過不足	▲12,100		▲26,900		+0		▲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	+4,400				+11,300				
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)					▲3,600 +7,300		▲2,500		
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲100 +3,500						
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	▲8,100		▲23,500		+15,000		▲11,500		
当座預金残高	2,110,100		2,086,600		2,101,600		2,090,100		
準備預金残高	1,914,100		1,914,100		1,914,100		1,914,100		
積み終了先	1,586,600		1,586,600		1,586,600		1,586,600		
超過準備	1,579,200		1,579,200		1,579,200		1,579,200		
非準備預金残高	196,000		196,000		196,000		196,000		
準備預金進捗率	96.3%		96.3%		96.3%		96.3%		
平均	16.1%		16.1%		16.1%		16.1%		
乖離率	80.2%		80.2%		80.2%		80.2%		
当座預金増減	▲8,100		▲23,500		+15,000		▲11,500		
準備預金残高	2,110,100		2,086,600		2,101,600		2,090,100		
積み終了先	1,586,600		1,586,600		1,586,600		1,586,600		
超過準備	1,579,200		1,579,200		1,579,200		1,579,200		
非準備預金残高	196,000		196,000		196,000		196,000		
準備預金進捗率	96.3%		96.3%		96.3%		96.3%		
平均	16.1%		16.1%		16.1%		16.1%		
乖離率	80.2%		80.2%		80.2%		80.2%		
共通担保(本店)							0		
共通担保(全店)							+8,000		
国債買現先							0		
CP買現先							0		
成長基盤強化							46,757		
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) 2,010,600

5/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 74,100

5/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円) 13年末実績 14年末実績 5/10

	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	回数	最高利回	平均利回
5/18	533(1Y)	-0.0069%	-0.0079%
5/14	532(3M)	0.0000%	-0.0024%
5/12	531(6M)	-0.0060%	-0.0060%

5/19 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	194,370	+8,331	-739
有担	126,556	-739	-
無担	67,814	+9,070	-

*出所:営業毎旬報告

*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

	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	0.070
ビッド	0.065	0.010	0.100	0.080
出来値	-	-	-	-

5/19 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,055,900

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	-	0.075	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.125	-	0.122	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.069	0.080	-	0.110	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.042	0.060	-	0.045	0.040	0.039	0.038	-	0.032	0.041	0.053

5/21 オペのオペと市場動向予想

足許金利は昨日同様0.06%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペは8000億円のオファーを予想する。

5/21 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(22日まで)
8:50 前週の対外対内証券売買(財務省)
13:30 3月の全産業活動指数(経産省)

5/21 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
4月の中古住宅販売件数

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	▲23,500	2,086,600	+2,086,600	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				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	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/5/22 ~ 2015/9/1	15,000	7,256	7,256	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
2015/5/19 ~ 2015/8/28	15,000	11,251	11,251	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2015/5/18 ~ 2015/8/17	8,000	1,331	1,331	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2015/5/11 ~ 2015/8/10	8,000	1,600	1,600	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/5/7 ~ 2015/8/3	8,000	1,360	1,360	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2015/4/27 ~ 2015/7/27	8,000	2,640	2,640	0.10%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/4/20 ~ 2015/7/21	8,000	1,265	1,265	0.10%	固定金利	-	札割れ	5/21 ~ 5/29	担保範囲内	2	2	0.620%	固定金利	-	1.00
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	0.10%	固定金利	-	札割れ	5/14 ~ 5/21	担保範囲内	0	0	0.630%	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