

DAILY SIGNAL

平成27年5月28日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは161兆6000億円だった。
本日の無担保コールON物は0.07%の出会いから始まり、その後は
0.07~0.072%を中心に取引された。一巡後は0.068~0.07%のレンジで
推移し、後場にかけてビッドは徐々に消え、引けた。
ターム物は2Wで0.11%台後半の出会い。

	即日オペ種類	オフア額	準備預金見込	所要対比
8:00	-	-	1,616,000	+1,616,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/28 のオペ結果
	5/28(木)		5/29(金)		6/1(月)		6/2(火)		
券	▲1,300		▲800		+1,000		+1,000		9:20 ノーオペ 11:50 国債補完供給(5/28-5/29) ▲0.400%全取 5億
財政	▲14,500		+2,900		▲10,000		▲22,000		
過不足	▲15,800		+2,100		▲9,000		▲21,000		
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					12:50 ノーオペ 13:00 共通担保(全店)(固定金利方式) (6/1-8/31) 0.10%(札割れ) 2070億
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)			▲4,700	+7,200	▲2,200	+2,100	▲11,800		
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲300		▲2,800	+2,500					
社債等買入	▲100								
ETF買入		+300							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援 貸出									共通担保(本店) 0 共通担保(全店) 72,268 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 3,244 ロンバート残高 0
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	▲15,900		+12,500		▲9,100		▲32,800		
当座預金残高	2,119,800		2,132,300		2,123,200		2,090,400		
準備預金残高	1,927,500								
積み終了先	1,615,200								
超過準備	1,614,900								
非準備先残高	192,300								
準備預金進捗率	99.1%								
平均	41.9%								
乖離率	57.1%								
当座預金増減	▲15,900		+12,500		▲9,100		▲17,800		
当座預金残高	2,119,800		2,132,300		2,123,200		2,105,400		
準備預金残高	1,927,500								
積み終了先	1,615,200								
超過準備	1,614,900								
非準備先残高	192,300								
準備預金進捗率	99.1%								
平均	41.9%								
乖離率	57.1%								

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,011,500
5/29 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 19,000
5/29 以降の残り積み立て額(残り所要)平均) 1,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	5/20
長期国債	142	202	234
CP等	2.2	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	5.0
J-REIT	0.14	0.18	0.22
貸出支援基金	9.2	25	28
国庫短期証券	40	49	51
その他とも資産計	224	300	338
銀行券	90	93	89
当座預金	107	178	211
その他とも負債・純資産計	224	300	338

T-Billの入札結果(直近3回)				
入札日	回号	最高利回	平均利回	
5/28	535(3M)	0.0040%	0.0012%	
5/21	534(3M)	0.0040%	0.0012%	
5/18	533(1Y)	-0.0069%	-0.0079%	

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オフア	0.120	0.080	0.060	0.080
ビッド	0.070	0.020	0.100	0.090
出来値	-	-	-	-

5/27 のコール市場残高(前日比)			
合計	有担	無担	
196,469	129,588	66,881	+3,738 +1,563 +2,175

5/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) **3,077,400**

*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	0.055	0.050	-	0.117	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.122	-	0.130	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.071	0.071	-	0.120	0.118	0.118	-	-	-	-	-
東京レポ・レート	0.052	0.073	-	0.049	0.044	0.040	0.037	-	0.033	0.041	0.053

5/29 オフアのオペと市場動向予想

明日の足許金利は、0.07~0.075%を中心に
取引されよう。共通担保オペはロールを予想。

5/29 の予定(国内)

8:30 4月完全失業率(総務省)
4月全国の消費者物価指数(総務省)
14:00 4月住宅着工件数(国土省)

5/29 の予定(海外)

米 1~3月のGDP2次速報
5月のシガン大学消費者信頼感確報

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	+12,500	2,132,300	+2,132,300	0.050	0.070	0.070	0.075	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	オフア額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2015/6/1 ~ 2015/8/31	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/5/29 ~ 2015/9/8	15,000	7,160	7,160	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/5/26 ~ 2015/9/4	15,000	7,210	7,210	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/5/25 ~ 2015/8/24	8,000	2,840	2,840	0.10%	固定金利	-	札割れ
2015/5/22 ~ 2015/9/1	15,000	7,256	7,256	0.10%	固定金利	-	札割れ
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

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	4,008	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

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
5/29 ~ 6/4	担保範囲内	0	0	0.610%	固定金利	-	応札なし
5/21 ~ 5/29	担保範囲内	2	2	0.620%	固定金利	-	1.00

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(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会