

DAILY SIGNAL

平成27年5月8日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは157兆9000億円だった。
本日の無担ON物は、0.067%の出会いからスタート。
その後も0.06%後半～0.07%で取引される堅調な地合いとなった。
後場に入っても0.06%台のビッドは残り、終日しっかりと地合いであった。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,579,000	+1,579,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/8 のオペ結果
	5/8(金)		5/11(月)		5/12(火)		5/13(水)		
券	+4,600		+3,400		+3,000		+3,000		9:20
財政	+1,300		▲3,100		▲12,000		▲2,000		ノーオペ
過不足	+5,900		+300		▲9,000		+1,000		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	ノーオペ
国債買入	+8,200		+8,000						10:40
国庫短期証券買入	+22,500								CP等買入(5/13-)
国債買現先									0.082%按分(42.9%) 3,488億
共通担保(本店)			▲2,200		+1,600				12:50
共通担保(全店)			▲500						ノーオペ
CP買現先	▲400								13:00
CP等買入							+3,500		ノーオペ
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	+36,200		+7,200		▲9,000		+4,500		
当座預金残高	2,083,900		2,091,100		2,082,100		2,086,600		
準備預金残高	1,896,200								
積み終了先	1,579,000		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,579,000								共通担保(全店) 68,232
非準備先残高	187,700								国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先 0
平均	83.9%		予想込増減 +7,200		予想込増減 ▲9,000		予想込増減 +4,500		成長基盤強化 46,757
乖離率	16.0%		当預見込 2,091,100		当預見込 2,082,100		当預見込 2,086,600		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) 1,939,300

5/11 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 400

5/11 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 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	0.050
ビッド	0.060	0.010	0.100	0.060
出来値	-	-	-	-

5/7 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,002,700

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	13年末実績	14年末実績	4/30
長期国債	142	202	230
CP等	2.2	2.2	2.2
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	333
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	210
その他とも負債・純資産計	224	300	333

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
5/8	530(3M)	-0.0020%	-0.0036%
4/28	529(3M)	-0.0020%	-0.0058%
4/23	528(3M)	-0.0040%	-0.0064%

5/7 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	206,120	+9,724	-364
	126,244	-	-
	79,876	+10,088	-

*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	4M	1Y
最低	0.055	0.058	-	-	0.180	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	-	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.068	0.072	-	0.116	0.202	-	0.290	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.050	0.050	-	0.041	0.039	0.039	0.037	-	0.033	0.041	0.053

5/11 オフアのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は0.06%台を中心に取引されるだろう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

5/11 の予定(国内)

8:50 預金種類別店頭金利の平均年利率等

5/11 の予定(海外)

米 FRBの4月の労働市場情勢指数 (日銀)

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	+7,200	2,091,100	+2,091,100	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	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	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					期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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	4/30 ~ 5/14	担保範囲内	0	0	0.620%	固定金利	-	札割れなし								
2015/4/13 ~ 2015/7/13	8,000	950	950	0.10%	固定金利	-	札割れ	4/23 ~ 4/30	担保範囲内	0	0	0.600%	固定金利	-	札割れなし								
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