

DAILY SIGNAL

平成27年5月22日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは158兆9000億円。
無担ON物は昨日からやや強含み朝方0.071%の出し合いからスタート。その後も0.07%台で推移した。後場に入り、一部0.06%台後半での取引が散見され引けた。
本日実施された日銀金融政策決定会合では金融市場調節方針の現状維持が決定された(賛成8反対1)。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,589,000	+1,589,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/22 のオペ結果
	5/22(金)		5/25(月)		5/26(火)		5/27(水)		
券	▲1,400		+300		+1,000		+0		9:20
財政	▲1,400		▲15,200		+11,000		▲2,000		ノオベ
過不足	▲2,800		▲14,900		+12,000		▲2,000		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	ノオベ
国債買入		+11,900							12:50
国庫短期証券買入									ノオベ
国債買現先									13:00
共通担保(本店)									共通担保(全店)×固定金利方式
共通担保(全店)	▲3,600	+7,300	▲2,500	+2,800	▲3,900	+7,200			(5/26-9/4)
CP買現先									0.10%(札割れ) 7,210億
CP等買入	▲200		▲500						
社債等買入			▲400						
ETF買入		+200		+200					
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	+12,800		▲15,300		+15,300		▲2,000		
当座預金残高	2,098,900		2,083,600		2,098,900		2,096,900		
準備預金残高	1,903,600		1,584,000		1,584,000		1,582,900		
積み終了先	1,584,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店) 0
超過準備	1,582,900		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) 68,529
非準備預金残高	195,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先 0
準備預金進捗率	98.2%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先 0
平均	29.0%		予想込増減 ▲15,300		予想込増減 +15,300		予想込増減 ▲2,000		成長基盤強化 46,757
乖離率	69.1%		当預見込 2,083,600		当預見込 2,098,900		当預見込 2,096,900		被災地金融機関支援 3,244
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,010,600
5/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 37,100
5/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,700

	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	-	-	-	-

5/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,025,400

(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
5/21	534(3M)	0.0040%	0.0012%
5/18	533(1Y)	-0.0069%	-0.0079%
5/14	532(3M)	0.0000%	-0.0024%

5/21 のコール市場残高(前日比)		
合計	有担	無担
195,586	127,912	67,674
+1,988	+90	+1,898

*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	-	-	0.180	-	-	-	-	-	-
最高	0.078	0.125	-	-	0.310	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.072	0.078	0.123	-	0.202	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	0.045	0.079	-	0.048	0.041	0.039	0.038	-	0.032	0.041	0.053

5/25 オファターのオペと市場動向予想

週明けの足許金利は、0.06%台後半で取引されよう。
共通担保オペはノオベを予想する。

5/25 の予定(国内)

8:50 4月の貿易統計(財務省)
14:00 5月の金融経済月報(日銀)

5/25 の予定(海外)

米 休日(メリアルデー)

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出し合いレンジ予想																			
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											
◎ ノオベ	▲15,300	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					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	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2015/5/26 ~ 2015/9/4	15,000	7,210	7,210	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
2015/5/25 ~ 2015/8/24	8,000	2,840	2,840	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	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2015/5/22 ~ 2015/9/1	15,000	7,256	7,256	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ					期間	オファー額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	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	5/21 ~ 5/29	担保範囲内	2	2	0.620%	固定金利	-	1.00	5/14 ~ 5/21	担保範囲内	0	0	0.630%	固定金利	-	応れなし
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																

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