

DAILY SIGNAL

平成30年4月5日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/5 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.065%の出合から始まった。
その後は▲0.075～▲0.045%での取引が見られた。
同加重平均金利は前日対比+0.001%の▲0.062%となった。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/5 のオペ結果
	4/5(木)		4/6(金)		4/9(月)		4/10(火)		
券	+400		+300		+1,000		+1,000		9:20 ノオベ
財政	▲31,400		+5,400		▲5,000		▲3,000		10:10 ノオベ
過不足	▲31,000		+5,700		▲4,000		▲2,000		10:40 CP等買入(4/10-)
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	▲0.007% 按分(26.7%) 2,485億
国債買入				+10,700					11:50 国債補完供給(4/5-4/6)
国庫短期証券買入				+5,000					▲0.600% 全取 10億
国債買現先					▲2,200	+1,600			12:50 ノオベ
国債売現先									13:00 共通担保(全店)<固定金利>
共通担保(本店)									(4/9-4/23)
共通担保(全店)									0% 全取 1,602億
CP買現先	▲400		▲200						
CP等買入									
社債等買入									
ETF買入				+100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		+100							
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲31,300		+21,300		▲4,600		+500		
当座預金残高	3,758,700		3,780,000		3,775,400		3,775,900		
準備預金残高	3,306,800								
積み終了先	3,306,700								
超過準備	3,306,700								
非準備先残高	451,900								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	67.7%		予想込増減 +21,300		予想込増減 ▲4,600		+500		
乖離率	32.2%		当預見込 3,780,000		当預見込 3,775,400		当預見込 3,775,900		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,053,200
4/6以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,200
4/6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		
オフー	-0.045	-0.100
ビッド	-0.075	0.000
出来値	-	-

4/4 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,874,900

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	16年末実績	17年末実績	3/20
長期国債	361	419	425
CP等	2.3	2.2	2.7
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	11.1	17.2	18.5
J-REIT	0.36	0.45	0.47
貸出支援基金	41	50	48
国庫短期証券	50	22	21
その他とも資産計	476	521	526
銀行券	102	107	104
当座預金	330	368	368
その他とも負債・純資産計	476	521	526

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
4/5	749 (3M)	-0.1303%	-0.1355%
4/3	748 (3M)	-0.1326%	-0.1393%
3/22	747 (3M)	-0.1503%	-0.1587%

4/4のコール市場残高(前日比)

合計	有担	無担
100,069	16,844	83,225
+2,452	+2,682	-230

*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	-0.075	-0.030	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.062	-0.017	-	-0.033	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.115	-0.109	-	-0.114	-0.115	-0.125	-0.132	-	-0.140	-0.153	-0.162

§ 4/6 の市場動向予想

足許は▲0.075～+0.001%のレンジで取引されよう。

4/6 の予定(国内)

10:00 日銀営業毎旬報告(3月31日現在)

4/6 の予定(海外)

米 3月の雇用統計
FRB議長の講演

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
4月6日 6ヶ月 第750回	4月12日 30年
4月12日 3ヶ月 第751回	4月17日 5年
4月18日 1年	4月19日 20年
4月19日 3ヶ月	4月24日 2年

翌営業日の出合いレンジ予想										
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y		
-0.075	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.020	-0.020	-0.010	-0.010		
~	~	~	~	~	~	~	~	~		
0.001	0.010	0.010	0.010	0.030	0.030	0.060	0.120	0.130		

日銀の国庫短期証券保有状況		
3月30日 時点の日銀保有残	187,528[億円]	
内、4月末までの償還分	-30,385[億円]	
03月30日以降の国庫短期証券追加買入分	4/6 スタート分	5,000[億円]
現時点の4月末合計額	162,143[億円]	

今月の国債買入オペ予定						
オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	直近日	残り回数	
1年以下	100~1,000億程度	500億	月2回程度	3月28日	2	
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	4 6 11 13 18 23	4月4日	5	
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	4 9 11 18 20 25	4月4日	5	
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4500億	2 9 13 20 25	4月2日	4	
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	1900億	月2回程度	4月2日	1	
25年超	500~1,500億程度	700億	月1回	2月19日	1	
物価連動債	250億程度	250億	月1回			
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	月1回			

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