

DAILY SIGNAL

平成30年4月6日(金)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

S 4/6 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▲0.07～▲0.045%での取引が見られた。
週末3日積みということもあり、調達意欲が昨日よりも強まり
同加重平均金利は前日対比+0.003%の▲0.059%となった。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/6 のオペ結果
	4/6(金)		4/9(月)		4/10(火)		4/11(水)		9:20 ノーオペ
券	+400		+1,000		+1,000		+0		10:10 国債買入(4/10-) (残存1年以下)
財政	+5,300		▲4,900		▲3,000		+3,000		+0.005% 按分(12.8%) 503億 (残存1年超3年以下)
過不足	+5,700		▲3,900		▲2,000		+3,000		▲0.003% 按分(26.6%) 2,505億 (残存3年超5年以下)
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	+0.003% 按分(64.5%) 3,304億
国債買入		+10,700				+6,300			11:50 国債補完供給(4/6-4/9) ▲0.600% 全取 56億
国庫短期証券買入		+5,000							12:50 ノーオペ
国債買現先									13:00 ノーオペ
国債売現先									13:50 国債補完供給(4/6-4/9) ▲0.600% 全取 19億
共通担保(本店)									
共通担保(全店)			▲2,200	+1,600					
CP買現先									
CP等買入	▲200					+2,500			
社債等買入									
ETF買入		+100		+1,000					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		▲100	+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	+21,200		▲3,400		+6,800		+3,000		
当座預金残高	3,779,900		3,776,500		3,783,300		3,786,300		
準備預金残高	3,323,500		主な需給予要因						
積み終了先	3,323,400		国庫短期証券 発行・償還(3M)		国庫短期証券 発行・償還(6M)				
超過準備	3,323,400								
非準備先残高	456,400								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	77.4%		予想込増減 ▲3,400		予想込増減 +6,800		+3,000		共通担保(全店) 3,652
乖離率	22.5%		当預見込 3,776,500		当預見込 3,783,300		当預見込 3,786,300		国債買現先 0 CP買現先 0 成長基盤強化 101,961 被災地金融機関支援 4,921 ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,064,000
4/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 800
4/9 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	-0.135
ビッド	-0.075	-	0.000	-0.125
出来値	-	-	-	-

4/5 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,843,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	16年末実績	17年末実績	3/31
長期国債	361	419	427
CP等	2.3	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	11.1	17.2	18.9
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	22
その他とも資産計	476	521	529
銀行券	102	107	104
当座預金	330	368	378
その他とも負債・純資産計	476	521	529

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
4/6	750 (6M)	-0.1534%	-0.1594%
4/5	749 (3M)	-0.1303%	-0.1355%
4/3	748 (3M)	-0.1326%	-0.1393%

4/5 のコール市場残高(前日比)

合計	104,574	+4,505
有担	21,582	+4,738
無担	82,992	-233

*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	-0.073	-0.030	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.180	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.059	-0.018	-	-0.035	-	0.035	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.116	-0.119	-	-0.123	-0.124	-0.134	-0.137	-	-0.143	-0.152	-0.162

S 4/9 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。

4/9 の予定(国内)

15:00 3月の景気ウォッチャー調査(内閣府)
黒田日銀総裁、再任

4/9 の予定(海外)

IMF、世界経済見通し

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
4月12日 3ヶ月 第751回	4月12日 30年
4月18日 1年	4月17日 5年
4月19日 3ヶ月	4月19日 20年
4月26日 3ヶ月	4月24日 2年

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]

翌営業日の出会いレンジ予想									
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	

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオフー金額	直近オフー額	オフー予定日	直近日	残り回数
1年以下	100～1,000億程度	500億	月2回程度	4月6日	1
1年超3年以下	2,000～3,000億程度	2500億	4 6 11 13 18 23	4月6日	4
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			
変動利付債(偶数月)	1,000億程度	1000億			

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