

DAILY SIGNAL

平成30年4月17日(火)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 4/17 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。
その後は主に▲0.085～▲0.045%の水準で取引が見られた。
昨日よりも調達意欲が弱まる地合となり、同加重平均金利は、
前日対比▲0.004%の▲0.063%となった。

(単位:億円)

日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/17 のオペ結果
4/17(火)		4/18(水)		4/19(木)		4/20(金)		
券	+300	▲700		▲2,000		▲2,000		9:20 ノーオペ
財政	+700	+3,300		▲18,000		+0		10:10 ノーオペ
過不足	+1,000	+2,600		▲20,000		▲2,000		10:40 米ドル資金供給(4/19-4/26) 貸付利率 2.200% 0百万米ドル
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		+8,600						11:50 国債補完供給(4/17-4/18) ▲0.600% 全取 2,725億
国庫短期証券買入		+2,500						
国債買現先								
国債売現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)								
CP買現先								
CP等買入	▲100	+2,500						12:50 ノーオペ
社債等買入								13:00 ノーオペ
ETF買入				+700				13:50 国債補完供給(4/17-4/18) ▲0.600% 全取 98億
J-REIT買入								
被災地金融機関支援							▲1,100	+1,300
貸出								
国債補完供給	+1,100	▲2,900	+2,900					
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	+12,700		+6,200		▲20,000		▲1,800	
当座預金残高	3,865,500		3,871,700		3,851,700		3,849,900	
準備預金残高	3,376,800				主な需給予想要因			
積み終了先	3,275,500				国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(1Y)	
超過準備	2,921,400							
非準備先残高	488,700							
準備預金進捗率	96.7%							
平均	6.7%		予想込増減	+6,200	予想込増減	▲20,000	▲1,800	
乖離率	90.1%		当預見込	3,871,700	当預見込	3,851,700	当預見込	3,849,900
								共通担保(全店) 3,292 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) 3,000,800
4/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 98,400
4/18 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 3,500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフー	-0.050	-	-0.100	-0.180
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.150
出来値	-	-	-	-

4/16 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,935,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	16年末実績	17年末実績	4/10
長期国債	361	419	430
CP等	2.3	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	11.1	17.2	19.2
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	20
その他とも資産計	476	521	530
銀行券	102	107	103
当座預金	330	368	378
その他とも負債・純資産計	476	521	530

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
4/12	751 (3M)	-0.1625%	-0.1685%
4/6	750 (6M)	-0.1534%	-0.1594%
4/5	749 (3M)	-0.1303%	-0.1355%

4/16 のコール市場残高(前日比)

合計	99,277	-18,336
有担	15,011	-5,768
無担	84,266	-12,568

*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	-0.086	-	-	-0.047	-0.055	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.040	-0.010	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.063	0.000	-	-0.044	-0.033	-	-	-	0.001	-	-
東京レボ・レート	-0.149	-0.158	-	-0.156	-0.201	-0.199	-0.196	-	-0.159	-0.157	-0.165

§ 4/18 の市場動向予想

足許は▲0.086～+0.001%のレンジで取引されよう。

4/18 の予定(国内)

8:50 3月の貿易統計(財務省)
14:00 3月の実質輸出入の動向(日銀)

4/18 の予定(海外)

米 ページブック
NY連銀総裁の講演
ユーロ圏 3月の消費者物価確報

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
4月18日 1年 第752回	4月19日 20年
4月19日 3ヶ月 第753回	4月24日 2年
4月26日 3ヶ月	5月8日 10年
5月2日 3ヶ月	5月10日 物価連動

日銀の国庫短期証券保有状況

4月10日 時点の日銀保有残	173,533[億円]
内、4月末までの償還分	-11,390[億円]
04月10日以降の	4/11 スタート分 5,002[億円]
国庫短期証券	4/17 スタート分 2,500[億円]
追加買入分	
現時点の4月末合計額	169,645[億円]

翌営業日の出合いレンジ予想									
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
-0.086	-0.055	-0.055	-0.050	-0.050	-0.040	-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13日	2
3年超5年以下	2,500～3,500億程度	3300億	4 9 11 13 18 20 25	4月11日	3
5年超10年以下	3,000～5,000億程度	4500億	2 9 13 20 25	4月13日	2
10年超25年以下	1,500～2,500億程度	1900億			
25年超	500～1,500億程度	700億			
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	4月2日	1
変動利付債(偶数月)	1,000億程度	1000億	月1回	2月19日	1

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