

DAILY SIGNAL

平成30年4月23日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/23 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.08%の出合から始まった。
前週末と同様、ビッドサイドが薄い地合いで
その後も▲0.08%台のビッドに対してギブンされる軟調な展開であった。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/23 のオペ結果
	4/23(月)		4/24(火)		4/25(水)		4/26(木)		
券	▲900		▲1,700		▲2,000		▲3,000		9:20
財政	+2,100		▲7,900		+6,000		▲2,000		ノーオペ
過不足	+1,200		▲9,600		+4,000		▲5,000		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	国債買入(4/25-)
国債買入				+7,200					(残存1年以下)
国庫短期証券買入				+2,500					+0.002% 按分(18.6%) 504億
国債買現先									(残存1年超3年以下)
国債売現先									+0.008% 按分(71.6%) 2,505億
共通担保(本店)									(残存3年超5年以下)
共通担保(全店)	▲1,600	+2,000							+0.008% 按分(74.5%) 3,305億
CP買現先									(物価連動債)
CP等買入	▲200		▲200						▲0.160円 按分(42.8%) 251億
社債等買入			▲100						11:50
ETF買入						+1,300			国債補完供給(4/23-4/24)
J-REIT買入									▲0.600% 全取 389億
被災地金融機関支援									12:50
貸出									ノーオペ
国債補完供給	+300	▲600	+600						13:00
米ドル供給用担保国債供給									ノーオペ
成長基盤強化支援									13:50
貸出増加支援									国債補完供給(4/23-4/24)
									▲0.600% 全取 159億
当座預金増減	+1,100		+400		+11,900		▲5,000		
当座預金残高	3,860,100		3,860,500		3,872,400		3,867,400		
準備預金残高	3,379,800		3,378,600		3,377,900		3,377,900		
積み終了先	3,378,600		申告所得税揚げ		3,377,900		3,377,900		
超過準備	3,377,900				480,300		480,300		
非準備先残高	480,300				99.8%		99.8%		
準備預金進捗率	99.8%				26.7%		26.7%		
平均	26.7%		予想込増減 +400		予想込増減 +11,900		▲5,000		
乖離率	73.1%		当預見込 3,860,500		当預見込 3,872,400		当預見込 3,867,400		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,000,800
4/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 5,800
4/24 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N	T+2
無担 ユーロ円 CP現先 レボG.C		
オフー	-0.050	-0.100
ビッド	-0.080	0.000
出来値	-	-

4/20 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,945,100

(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
4/19	753 (3M)	-0.1744%	-0.1804%
4/18	752 (1Y)	-0.1757%	-0.1796%
4/12	751 (3M)	-0.1625%	-0.1685%

4/20 のコール市場残高(前日比)

合計	92,350	-2,472
有担	15,578	+1,932
無担	76,772	-4,404

*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	-0.030	-	-0.060	-0.055	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	-0.048	-0.050	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.071	-0.010	-	-0.057	-0.053	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.147	-0.134	-	-0.205	-0.195	-0.186	-0.180	-	-0.164	-0.155	-0.166

§ 4/24 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。

4/24 の予定(国内)

8:50 3月の企業向けサービス価格(日銀)

10:00 4/20現在の営業毎旬報告(日銀)

14:00 2月の景気動向指数改定値(内閣府)

4/24 の予定(海外)

米 米仏首脳会談(ワシントン)

3月の新築住宅販売件数

4月の消費者信頼感指数

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
4月26日 3ヶ月 第754回	4月24日 2年
5月2日 3ヶ月	5月8日 10年
5月9日 6ヶ月	5月10日 物価連動
5月11日 3ヶ月	5月15日 30年

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		

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	4/24 スタート分	2,500[億円]
現時点の4月末合計額	172,145[億円]	

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23日	0	
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	4 6 11 13 18 23	4月23日	0	
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億				
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4500億	4 9 11 18 20 25	4月20日	1	
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	2 9 13 20 25	4月20日	1	
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	4月23日	0	
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	月1回	4月18日	0	

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