

DAILY SIGNAL

5/7 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。
その後は▲0.086%～▲0.06%のレンジで取引された。
調達一巡後はビッドが薄く、▲0.08%台での出合も散見された。
ターム物は1W物で▲0.06%～▲0.05%台の出合が見られた。

平成30年5月7日(月)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/7 のオペ結果
	5/7(月)		5/8(火)		5/9(水)		5/10(木)		
券	+3,800		+3,100		+3,000		+2,000		9:20 ノーオペ
財政	▲33,600		+500		▲24,000		▲8,000		10:10 国庫短期証券買入(5/8-)
過不足	▲29,800		+3,600		▲21,000		▲6,000		+0.002% 按分(36.9%)5,000億 国債買入(5/8-)
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	(残存1年超3年以下)
国債買入				+8,700					+0.000% 按分(27.3%)2,506億
国庫短期証券買入				+5,000					(残存3年超5年以下)
国債買現先									▲0.003% 按分(36.5%)3,306億
国債売現先									(残存10年超25年以下)
共通担保(本店)	▲2,000	+1,800							+0.000% 按分(26.9%)1,912億
共通担保(全店)									(残存25年超)
CP買現先			▲400						+0.001% 按分(8.5%)706億
CP等買入									10:25 国債補完供給(5/7-5/8)
社債等買入									▲0.600% 全取 19億
ETF買入									11:50 国債補完供給(5/7-5/8)
J-REIT買入									▲0.600% 全取 156億
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲200	+200						12:50 ノーオペ
米ドル供給用担保国債供給									13:00 ノーオペ
成長基盤強化支援									13:50 国債補完供給(5/7-5/8)
貸出増加支援									▲0.600% 全取 12億
当座預金増減	▲30,000		+17,100		▲21,000		▲6,000		
当座預金残高	3,841,200		3,858,300		3,837,300		3,831,300		
準備預金残高	3,374,900				主な需給要因				
積み終了先	3,374,700				国債発行(10年)		国庫短期証券 発行・償還(6M)		共通担保(全店) 4,443
超過準備	3,374,700								国債買現先 0
非準備先残高	466,300								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化 101.961
平均	73.3%		予想込増減	+17,100	予想込増減	▲21,000	▲6,000		被災地金融機関支援 5,118
乖離率	26.6%		当預見込	3,858,300	当預見込	3,837,300	当預見込	3,831,300	ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,009,600
5/8 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,500
5/8 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	レボG.C	CP現先
オフア	-0.060	-	-0.065	-0.100
ビッド	-0.086	-	-0.045	0.000
出来値	-	-	-	-

5/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,971,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	16年末実績	17年末実績	4/30
長期国債	361	419	434
CP等	2.3	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	11.1	17.2	19.5
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	20
その他とも資産計	476	521	535
銀行券	102	107	105
当座預金	330	368	388
その他とも負債・純資産計	476	521	535

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回り	平均利回り
5/2	755 (3M)	-0.1323%	-0.1411%
4/26	754 (3M)	-0.1358%	-0.1556%
4/19	753 (3M)	-0.1744%	-0.1804%

5/2 のコール市場残高(前日比)

合計	98,399	+6,198
有担	24,366	+2,740
無担	74,033	+3,458

*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	-	-	-0.040	-0.032	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.035	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.072	0.000	-	-0.037	-0.016	-0.010	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.065	-0.082	-	-0.091	-0.097	-0.105	-0.120	-	-0.138	-0.151	-0.160

5/8 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。

5/8 の予定(国内)

8:30 消費動向指数(3月)

5/8 の予定(海外)

なし

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
5月9日 6ヶ月 第756回	5月8日 10年
5月11日 3ヶ月 第757回	5月10日 物価連動
5月17日 1年	5月15日 30年
5月18日 3ヶ月	5月17日 5年

日銀の国庫短期証券保有状況

4月27日 時点の日銀保有残	172,145[億円]
内、5月末までの償還分	-44,767[億円]
04月27日以降の	5/2 スタート分 5,002[億円]
国庫短期証券	5/8 スタート分 5,000[億円]
追加買入分	
現時点の5月末合計額	137,380[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	-0.065	-0.065	-0.060	-0.060	-0.050	-0.020	-0.010	-0.010
～	～	～	～	～	～	～	～	～
0.001	0.010	0.010	0.010	0.030	0.030	0.070	0.120	0.130

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ額	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	5月1日	1
1年超3年以下	2,000～3,000億程度	2500億	7 9 14 18 23 25	5月7日	5
3年超5年以下	2,500～3,500億程度	3300億	7 9 14 18 25 30	5月1日	5
5年超10年以下	3,000～5,000億程度	4500億	7 11 16 23 30	5月7日	4
10年超25年以下	1,500～2,500億程度	1900億	7 11 16 23 30	5月7日	4
25年超	500～1,500億程度	700億	7 11 16 23 30	5月7日	4
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	4月23日	2
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	月1回	4月18日	-

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