

DAILY SIGNAL

平成30年5月9日(水)

上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/9 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.06%の出合から始まった。
 その後は▲0.065%～▲0.055%のレンジで取引された。
 同加重平均金利(速報)は前日対比+0.011%の▲0.052%となった。
 ターム物は1W物で▲0.05%台の出合が見られた。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/9 のオペ結果
	5/9(水)		5/10(木)		5/11(金)		5/14(月)		
券	+3,000		+1,500		+2,000		+2,000		9:20 ノーオペ 10:10 国債買入(5/10-) (残存1年超3年以下) +0.002% 按分(11.6%) 2,512億 (残存3年超5年以下) +0.006% 按分(59.7%) 3,304億 (残存5年超10年以下) +0.002% 按分(33.3%) 4,511億 10:25 国債補完供給(5/9-5/10) ▲0.600% 全取 1億 11:50 国債補完供給(5/9-5/10) ▲0.600% 全取 43億 12:50 ノーオペ 13:00 ノーオペ 13:50 国債補完供給(5/9-5/10) ▲0.600% 全取 2億
財政	▲24,300		▲8,600		▲4,000		▲13,000		
過不足	▲21,300		▲7,100		▲2,000		▲11,000		
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				+10,500					
国庫短期証券買入									
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)							▲2,400		
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲400			+2,000			
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給									
米ドル供給用担保国債供給	+100								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲21,400		+3,000		+0		▲13,400		
当座預金残高	3,836,500		3,839,500		3,839,500		3,826,100		
準備預金残高	3,375,800								
積み終了先	3,375,600								
超過準備	3,375,600								
非準備先残高	460,700								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	80.0%								
乖離率	19.9%								
			予想込増減	+3,000	予想込増減	+0		▲13,400	
			当預見込	3,839,500	当預見込	3,839,500	当預見込	3,826,100	
								共通担保(全店) 4,443	
								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 5,118	
								ロンハート残高 0	

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,026,100
 5/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,200
 5/10 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N	ユーロ円	レボG.C	CP現先
オフア	-0.040	-	-0.060	-0.100
ビッド	-0.065	-	-0.045	0.000
出来値	-	-	-	-

5/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,951,100

(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	回数	最高利回	平均利回
5/9	756 (6M)	-0.1255%	-0.1294%
5/2	755 (3M)	-0.1323%	-0.1411%
4/26	754 (3M)	-0.1358%	-0.1556%

5/8 のコール市場残高(前日比)

合計	有担	無担
101,918	24,740	77,178
-4,133	-1,187	-2,946

*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	-0.070	-	-	-0.050	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.052	0.000	-	-0.049	-	-	0.000	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.060	-0.065	-	-0.083	-0.091	-0.100	-0.113	-	-0.133	-0.147	-0.161

5/10 の市場動向予想

足許は▲0.07～+0.001%のレンジで取引されよう。

5/10 の予定(国内)

8:50 日銀金融政策決定会合における
 主な意見(4月26・27日分)
 14:00 景気ウォッチャー調査(4月)

5/10 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
 消費者物価(4月)

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
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
5月25日 3ヶ月	5月22日 20年

翌営業日の出合いレンジ予想									
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
-0.070	-0.055	-0.055	-0.055	-0.055	-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	

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]	

今月の国債買入オペ予定						
オペ種類	一回当たりオフア-金額	直近オフア-額	オフア-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	14 18 23 25	5月9日	4
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	7	14 18 23 25	5月9日	4
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4500億	7	14 18 23 25	5月9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