

DAILY SIGNAL

平成30年5月11日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

5/11 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.04%の出合から始まり、その後は▲0.045%～▲0.03%の水準で取引される堅調な地合となった。
同加重平均金利(速報)は、前日対比+0.008%の▲0.034%となった。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				5/11 のオペ結果
	5/11(金)		5/14(月)		5/15(火)		5/16(水)		
券		+1,700		+1,400		+1,000		+1,000	9:20 ノオベ 10:10 国債買入(5/14-) (残存10年超25年以下) +0.002% 按分(18%) 1,916億 (残存25年超) +0.003% 按分(81.2%) 703億 (物価連動債) ▲0.100円 全取250億 11:50 国債補完供給(5/11-5/14) ▲0.500% 全取 948億 12:50 ノオベ 13:00 共通担保(全店)<固定金利> (5/14-5/28) 0% 全取 1,981億
財政		▲7,100		▲10,700		▲12,000		▲7,000	
過不足		▲5,400		▲9,300		▲11,000		▲6,000	
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				+3,100					
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	+2,000					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲100	+2,000	▲300						
社債等買入									
ETF買入		+700							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲1,000	+1,000						
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		▲3,600		▲5,900		▲11,000		▲6,000	
当座預金残高		3,836,900		3,831,000		3,820,000		3,814,000	
準備預金残高		3,380,900							
積み終了先		3,380,700							
超過準備		3,380,700							
非準備先残高		456,000							
準備預金進捗率		99.9%							
平均		93.3%							
乖離率		6.6%							
当座見込			▲5,900		▲11,000			▲6,000	
当預見込			3,831,000		3,820,000			3,814,000	

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,026,100
5/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 300
5/14 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	-0.030	-	-0.065	-0.100
ビッド	-0.060	-	-0.045	0.000
出来値	-	-	-	-

5/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,929,000**

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.060	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.034	0.000	-	-0.026	0.020	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.055	-0.059	-	-0.071	-0.081	-0.095	-0.109	-	-0.131	-0.147	-0.160

5/14 の市場動向予想

足許は▲0.06～+0.001%のレンジで取引されよう。

5/14 の予定(国内)

8:50 4月の企業物価指数(日銀)
10:00 5月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

5/14 の予定(海外)

米 セントリス連銀総裁の講演

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
5月17日 1年 第758回	5月15日 30年
5月18日 3ヶ月 第759回	5月17日 5年
5月25日 3ヶ月	5月22日 20年
6月1日 3ヶ月	5月29日 40年

翌営業日の出合いレンジ予想									
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
-0.060	-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	0.060	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	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	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				
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	9 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	1 9 14 18 25 30	5月9日	4	
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	11 16 23 30	5月11日	3	
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	5月11日	1	
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