

DAILY SIGNAL

平成30年4月20日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/20 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。
その後は主に▲0.086~▲0.05%の水準で取引された。
同加重平均金利は、前日対比▲0.001%の▲0.07%となった。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/20 のオペ結果
	4/20(金)		4/23(月)		4/24(火)		4/25(水)		
券	▲1,300		▲600		▲2,000		▲2,000		9:20 ノオペ
財政	▲1,000		+3,900		▲12,000		+6,000		10:10 国庫短期証券買入(4/24-)
過不足	▲2,300		+3,300		▲14,000		+4,000		+0.005% 按分(84%) 2,500億
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(4/24-)
国債買入		+11,500				+7,100			(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入						+2,500			+0.008% 按分(96%) 4,512億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
国債売現先									+0.011% 按分(40.5%) 1,902億
共通担保(本店)			▲1,600	+2,000					(残存25年超)
共通担保(全店)									+0.010% 按分(96.4%) 706億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲500		▲200						国債補完供給(4/20-4/23)
社債等買入	▲300								▲0.600% 全取 221億
ETF買入									12:50
J-REIT買入									ノオペ
被災地金融機関支援	▲1,100	+1,300							13:00
貸出									ノオペ
国債補完供給		▲300	+300						
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	+8,300		+3,800		▲4,400		+5,300		
当座預金残高	3,859,000		3,862,800		3,858,400		3,863,700		
準備預金残高	3,362,300								
積み終了先	3,359,500		国庫短期証券発行・償還		申告所得税揚げ				共通担保(全店) 3,292
超過準備	3,358,100		(3M)						国債買現先 0
非準備先残高	496,700		国債発行(20年)						CP買現先 0
準備預金進捗率	99.7%								成長基盤強化 101,961
平均	23.3%		予想込増減 +3,800		予想込増減 ▲4,400		+5,300		被災地金融機関支援 5,118
乖離率	76.4%		当預見込 3,862,800		当預見込 3,858,400		当預見込 3,863,700		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,000,800
4/23 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,700
4/23 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	-0.060	0.000
出来値	-	-

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

4/19 のコール市場残高(前日比)

	合計	94,822	-1,656
有担	13,646	+95	
無担	81,176	-1,751	

*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	-	-0.055	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.070	-0.010	-	-0.039	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.151	-0.159	-	-0.221	-0.218	-0.206	-0.203	-	-0.166	-0.156	-0.168

§ 4/23 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。

4/23 の予定(国内)

14:00 3月の実質輸出入の詳細(日銀)

4/23 の予定(海外)

米 米仏首脳会談(ワシントン)
4月製造業PMI、サービス業PMI速報
ユーロ圏 4月製造業PMI、サービス業PMI速報

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	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	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18日	1
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	4 9 11 18 20 25	4月20日	1
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	4 9 13 20 25	4月20日	1
25年超	500~1,500億程度	700億	月2回程度	4月2日	1
物価連動債	250億程度	250億	月1回	4月18日	0
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億			

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