

DAILY SIGNAL

平成30年4月11日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 4/11 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.055%の出合から始まった。
その後は主に▲0.06～▲0.045%の水準で取引が見られた。
一部で、昨日よりも旺盛な調達が見られ、
同加重平均金利は前日対比+0.002%の▲0.053%となった。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				4/11 のオペ結果
	4/11(水)		4/12(木)		4/13(金)		4/16(月)		
券	+400		▲900		▲1,000		+1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(4/13-) (残存1年超3年以下) +0.003% 按分(10.1%)2,505億 (残存3年超5年以下) +0.002% 按分(30.2%)3,304億 (残存5年超10年以下) +0.000% 按分(14.1%)4,506億 11:50 国債補完供給(4/11-4/12) ▲0.600% 全取 201億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	▲800		▲5,900		+78,000		▲22,000		
過不足	▲400		▲6,800		+77,000		▲21,000		
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		+7,600				+10,300			
国庫短期証券買入		+5,000							
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)							▲1,300		
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲100						
社債等買入									
ETF買入		+1,400							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+100	▲200	+200						
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	+13,400		▲6,700		+87,300		▲22,300		
当座預金残高	3,794,100		3,787,400		3,874,700		3,852,400		
準備預金残高	3,307,000								
積み終了先	3,306,900		源泉税揚げ		年金定時払い		国庫短期証券発行・償還 (3M)		
超過準備	3,306,900						国債発行・償還(2年)		
非準預金残高	487,100						国債発行(30年)		
準備預金進捗率	99.9%								
平均	87.1%		予想込増減 ▲6,700		予想込増減 +87,300		▲22,300		
乖離率	12.8%		当預見込 3,787,400		当預見込 3,874,700		当預見込 3,852,400		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,064,000
4/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 400
4/12 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	-0.050	-	-0.100	-0.185
ビッド	-0.070	-	0.000	-0.145
出来値	-	-	-	-

4/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,863,000**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	16年末実績	17年末実績	3/31
長期国債	361	419	427
CP等	2.3	2.2	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	11.1	17.2	18.9
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	22
その他も資産計	476	521	529
銀行券	102	107	104
当座預金	330	368	378
その他も負債・純資産計	476	521	529

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	最高利回	平均利回
4/6	750 (6M)	-0.1534%	-0.1594%
4/5	749 (3M)	-0.1303%	-0.1355%
4/3	748 (3M)	-0.1326%	-0.1393%

4/10 のコール市場残高(前日比)

	合計	102,534	+5,997
有担	14,630	-983	
無担	87,904	+6,980	

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特別分含む。

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	-	-0.050	-0.025	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	-0.040	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	-0.042	-	-0.048	-0.022	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.145	-0.149	-	-0.158	-0.160	-0.187	-0.188	-	-0.156	-0.156	-0.165

§ 4/12 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。

4/12 の予定(国内)

8:50 3月のマネーストック(日銀)
10:00 4月10日現在の営業毎旬報告(日銀)
未定 地域経済報告(日銀)

4/12 の予定(海外)

米 3月の輸出入物価
ユーロ圏 2月の鉱工業生産

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
4月12日 3ヶ月 第751回	4月12日 30年
4月18日 1年	4月17日 5年
4月19日 3ヶ月	4月19日 20年
4月26日 3ヶ月	4月24日 2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	-0.050	-0.050	-0.050	-0.050	-0.020	-0.020	-0.010	-0.010	
~	~	~	~	~	~	~	~	~	
0.001	0.010	0.010	0.010	0.030	0.030	0.060	0.120	0.130	

日銀の国庫短期証券保有状況	
3月30日 時点の日銀保有残	187,528[億円]
内、4月末までの償還分	-30,385[億円]
03月30日以降の	4/6 スタート分 5,000[億円]
国庫短期証券	4/11 スタート分 5,002[億円]
追加買入分	
現時点の4月末合計額	167,145[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	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11日	3
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	4 9 11 18 20 25	4月11日	3
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4500億			
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	1900億	2 9 13 20 25	4月9日	3
25年超	500~1,500億程度	700億			
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	4月2日	1
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	月1回	2月19日	1

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