

DAILY SIGNAL

平成30年3月20日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/20 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は、▲0.065%の出合から始まり、その後は▲0.085%～▲0.060%でのレンジで取引される軟調な地合となった。調達一巡後は調整程度の出合が散見されて引けた。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/20 のオペ結果
	3/20(火)		3/22(木)		3/23(金)		3/26(月)		
券	▲900		▲1,500		▲1,000		+0		9:20 ノオベ
財政	+49,400		+9,100		▲5,000		+24,000		10:10 ノオベ
過不足	+48,500		+7,600		▲6,000		+24,000		10:40 ノオベ
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	米ドル資金供給(3/22-3/29) 貸付利率 2.160% 0百万米ドル 11.50 国債補完供給(3/20-3/22) ▲0.600% 全取 63億
国債買入	+3,300		+10,400						12:50 ノオベ
国庫短期証券買入			+7,500						13:00 ノオベ
国債買現先							▲1,200		
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(本店)									
CP買現先									
CP等買入	▲500		▲1,000						
社債等買入	▲1,500		▲100						
ETF買入			+900						
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲100	+100						
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	+49,900		+25,400		▲6,000		+24,300		
当座預金残高	3,685,400		3,710,800		3,704,800		3,729,100		
準備預金残高	3,233,400				主な需給要因				
積み終了先	3,227,300						国庫短期証券発行・償還(3M)		共通担保(全店) 2,692
超過準備	3,218,100						年度末諸払い		国債買現先 0
非準備先残高	452,000								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.2%								成長基盤強化 101.961
平均	19.4%		予想込増減 +25,400		予想込増減 ▲6,000		+24,300		被災地金融機関支援 4,921
乖離率	79.8%		当預見込 3,710,800		当預見込 3,704,800		当預見込 3,729,100		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,052.900
3/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 25,800
3/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,000

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	-0.050	-	-0.100	-0.175
ビッド	-0.085	-	0.000	-0.155
出来値	-	-	-	-

3/19 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,719,400

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.085	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.020	-	-	0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.061	0.000	-	-0.026	-	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.117	-0.154	-	-0.164	-0.236	-0.200	-0.178	-	-0.160	-0.155	-0.165

§ 3/22 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。

3/22 の予定(国内)

3/22 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
3月の製造業PMI

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
3月22日 3ヶ月 第747回	3月27日 40年
4月3日 3ヶ月	3月29日 2年
4月5日 3ヶ月	4月3日 10年
4月6日 6ヶ月	4月12日 30年

日銀の国庫短期証券保有状況		3月9日 時点の日銀保有残	186,337[億円]
内、3月末までの償還分		-16,310[億円]	
03月09日以降の	3/14 スタート分	7,500[億円]	
国庫短期証券	3/22 スタート分	7,500[億円]	
追加買入分			
現時点の3月末合計額		185,027[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	-0.010	-0.010	-0.010	-0.010	-0.010	-0.010	-0.010	-0.010	
~	~	~	~	~	~	~	~	~	
0.001	0.010	0.030	0.030	0.060	0.060	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	3月16日	1	
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	2 7 14 19 23 30	3月19日	2	
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	2 12 14 19 22 30	3月19日	2	
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	7 12 16 22 28	3月16日	2	
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	3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