

DAILY SIGNAL

平成30年2月9日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/9 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは319兆4,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.02%の合出から始まり、
その後は▲0.055%～▲0.015%のレンジで取引された。
なお、同加重平均金利(速報)は前日比+0.002%の▲0.034%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,194,000	3,194,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/9 のオペ結果
	2/9(金)		2/13(火)		2/14(水)		2/15(木)		
券	▲300		+900		+0		▲1,000		9:20 ノオペ
財政	▲900		▲2,700		+0		+56,000		10:10 ノオペ
過不足	▲1,200		▲1,800		+0		+55,000		11:50 ノオペ
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	13:00 ノオペ
国債買入		+10,800				+8,500			14:00 ノオペ
国庫短期証券買入						+12,500			
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)			▲1,500	+900					
共通担保(全店)									
CP買現先			▲200						
CP等買入	▲200					+2,500			
社債等買入									
ETF買入		+400		+700					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+500	▲2,300	+2,300						
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	+8,000		+400		+23,500		+55,000		
当座預金残高	3,605,900		3,606,300		3,629,800		3,684,800		
準備預金残高	3,190,800		3,190,700		3,190,700		3,190,700		
積み終了先	3,190,700		3,190,700		3,190,700		3,190,700		
超過準備	3,190,700		3,190,700		3,190,700		3,190,700		
非準備先残高	415,100		415,100		415,100		415,100		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	90.3%		90.3%		90.3%		90.3%		
乖離率	9.6%		9.6%		9.6%		9.6%		
主な需給要因			国庫短期証券発行・償還(3M・6M)		国債発行(30年)		年金定時払い 源泉税揚げ 国債発行・償還(2年)		共通担保(全店) 2,932 国債買現先 0 CP買現先 0 成長基盤強化 98,295 被災地金融機関支援 4,921 ロンハート残高 0
予想込増減	+400		+400		+23,500		+55,000		
当預見込	3,606,300		3,606,300		3,629,800		3,684,800		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,069,100
2/13以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 300
2/13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
オファー	-0.015	-	-0.100	-0.105
ビッド	-0.040	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

2/8 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,677,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	1/31
長期国債	282	361	424
CP等	2.2	2.3	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	17.7
J-REIT	0.27	0.36	0.45
貸出支援基金	31	41	50
国庫短期証券	43	50	22
その他とも資産計	383	476	527
銀行券	98	102	103
当座預金	253	330	369
その他とも負債・純資産計	383	476	527

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
2/8	738 (3M)	-0.1479%	-0.1524%
2/7	737 (6M)	-0.1454%	-0.1495%
2/1	736 (3M)	-0.1503%	-0.1595%

2/8のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	110,547	+7,705	-19
	22,173	-	-
	88,374	+7,724	-

*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	-0.075	-	-	-0.025	-0.025	-	-	-	-	-	-
最高	0.050	-	-	0.130	0.020	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.034	0.000	-	-0.006	-0.003	0.030	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.090	-0.093	-	-0.094	-0.095	-0.098	-0.102	-	-0.125	-0.147	-0.162

§ 2/13の市場動向予想

足許は▲0.075%～+0.001%のレンジで取引されよう。

2/13の予定(国内)

8:50 1月の企業物価指数(日銀)

2/13の予定(海外)

なし

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
2月15日 3ヶ月 第739回	2月14日 5年
2月16日 1年	2月22日 20年
2月22日 3ヶ月	2月27日 2年
3月1日 3ヶ月	3月1日 10年

翌営業日の出合いレンジ予想									
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
-0.075	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.030	-0.020	-0.010	-0.010	
~	~	~	~	~	~	~	~	~	
0.001	0.010	0.030	0.030	0.060	0.060	0.070	0.120	0.130	

日銀の国庫短期証券保有状況

当面の残高のめど	概ね10兆円台後半から20兆円台前半
1月31日 時点の日銀保有残	191,643[億円]
内、2月末までの償還分	-33,625[億円]
01月31日以降の	2/6 スタート分 7,501[億円]
国庫短期証券	2/14 スタート分 12,502[億円]
追加買入分	
現時点の2月末合計額	178,021[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	2月2回程度	1月29日	2
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	2月9日	2月9日	4
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	2月7日	2月7日	4
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4500億	2月9日	2月9日	3
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	1900億	2月7日	2月7日	1
25年超	500~1,500億程度	800億	2月7日	2月7日	1
物価連動債	250億程度	250億	2月7日	2月7日	1
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	12月15日	12月15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