DAILY SIGNAL

平成30年2月16日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/16 のオペと市場動向

積み初日となる本日の無担保コールON物は▲0.04%の割合から始まり、その後は▲0.055%～▲0.025%の水準で取引された。調達一巡後は▲0.06%台で調整程度の割合が散見されて引けた。なお、同加重平均金利(速報)は前日比▲0.009%の▲0.042%となった。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/16 のオペ結果
	2/16(金)		2/19(月)		2/20(火)		2/21(水)		
券	▲400		+200		+0		▲1,000		9:20 ノオベ
財政	▲24,600		▲3,600		▲20,000		▲1,000		10:10 ノオベ
過不足	▲25,000		▲3,400		▲20,000		▲2,000		11:50 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	12:50 ノオベ
国債買入				+10,500					13:00 ノオベ
国庫短期証券買入									ノオベ
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)			▲1,400	+2,300					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲100			+2,500			
社債等買入									
ETF買入		+800		+600					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+500	▲700	+700						
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	▲24,500		+9,200		▲17,500		▲2,000		
当座預金残高	3,659,700		3,668,900		3,651,400		3,649,400		
準備預金残高	3,225,800		3,205,200		3,205,200		3,205,200		
積み終了先	3,205,200		3,205,200		3,205,200		3,205,200		
超過準備	2,324,800		2,324,800		2,324,800		2,324,800		
非準備先残高	433,900		433,900		433,900		433,900		
準備預金進捗率	98.2%		98.2%		98.2%		98.2%		
平均	10.7%		10.7%		10.7%		10.7%		
乖離率	87.4%		87.4%		87.4%		87.4%		
主な需給要因			国庫短期証券発行・償還(3M)		国庫短期証券発行・償還(1Y)				共通担保(全店) 2,333
									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

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,753,600
2/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 50,800
2/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,000

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	-0.025	-	-0.100	-0.105
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

2/15 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,763,000**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	2/10
長期国債	282	361	426
CP等	2.2	2.3	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	17.8
J-REIT	0.27	0.36	0.46
貸出支援基金	31	41	50
国庫短期証券	43	50	23
その他とも資産計	383	476	530
銀行券	98	102	103
当座預金	253	330	360
その他とも負債・純資産計	383	476	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
2/16	740 (1Y)	-0.1607%	-0.1627%
2/15	739 (3M)	-0.1563%	-0.1607%
2/8	738 (3M)	-0.1479%	-0.1524%

2/15 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	110,543	-1,536	-530
	21,837	-	-
	88,706	-1,006	-

*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	-0.070	-	-	-0.030	-0.030	-	-0.025	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.015	-0.025	-	0.060	-	-	-	-
加重平均	-0.042	0.000	-	-0.024	-0.028	-	-0.016	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.094	-0.098	-	-0.103	-0.107	-0.109	-0.111	-	-0.143	-0.150	-0.163

§ 2/19 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。

2/19 の予定(国内)

8:50 1月の貿易統計(財務省)

2/19 の予定(海外)

米 休日
ユーロ圏 12月の経常収支

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
2月22日 3ヶ月 第741回	2月22日 20年
3月1日 3ヶ月	2月27日 2年
3月7日 6ヶ月	3月1日 10年
3月8日 3ヶ月	3月6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	
-0.070	-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
2月9日 時点の日銀保有残	197,195[億円]
内、2月末までの償還分	-31,676[億円]
02月09日以降の国庫短期証券追加買入分	2/14 スタート分 12,502[億円]
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	一回当たりオフア金額	直近オフア額	オフア予定日	直近日	残り回数	
1年以下	100~1,000億程度	500億	月2回程度	2月13日	1	
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	2月9日	2月15日	3	
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	2月7日	2月15日	2	
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9日	2月9日	3	
25年超	500~1,500億程度	800億	2月9日	2月9日	3	
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	2月7日	1	
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	月1回	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