

DAILY SIGNAL

平成30年2月26日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 2/26 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合からスタート。
その後は▲0.065%~▲0.03%のレンジで出合が見られた。
同加重平均金利(速報)は前日比▲0.002%の▲0.048%となった。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				2/26 のオペ結果
	2/26(月)		2/27(火)		2/28(水)		3/1(木)		
券	▲300		▲800		▲400		+0		9:20 ノオペ
財政	▲17,100		+4,200		+4,700		▲7,000		10:10 国債買入(2/28-)
過不足	▲17,400		+3,400		+4,300		▲7,000		(残存1年以下)
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	+0.002% 全取500億
国債買入				+8,800		+5,300			(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入				+2,500					+0.000% 按分(87.6%)4,507億
国債買現先									(物価連動債)
国債売現先									▲0.060円 按分(28.2%)252億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)	▲800	+1,300							国債補完供給(2/26-2/27)
CP買現先									▲0.500% 全取 1,221億
CP等買入	▲700		▲200			+2,500			
社債等買入		+1,000							12:50
ETF買入		+500		+400					ノオペ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノオペ
貸出									
国債補完供給	+500	▲1,200	+1,200						
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	▲16,800		+16,100		+12,100		▲7,000		
当座預金残高	3,645,000		3,661,100		3,673,200		3,666,200		
準備預金残高	3,195,700								
積み終了先	3,195,300								
超過準備	3,195,200								
非準備先残高	449,300								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	39.3%		予想込増減 +16,100		予想込増減 +12,100		▲7,000		
乖離率	60.6%		当預見込 3,661,100		当預見込 3,673,200		当預見込 3,666,200		

共通担保(全店)	3,684
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
2/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,900
2/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	-0.025	-	-0.100	-0.180
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.160
出来値	-	-	-	-

2/23 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,745,000**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	2/20
長期国債	282	361	427
CP等	2.2	2.3	2.5
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	18.1
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	21
その他とも資産計	383	476	530
銀行券	98	102	103
当座預金	253	330	365
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
2/22	741 (3M)	-0.1764%	-0.1880%
2/16	740 (1Y)	-0.1607%	-0.1627%
2/15	739 (3M)	-0.1563%	-0.1607%

2/23 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	116,076	+9,096	-1,988
	20,708	-	+11,084
	95,368	-	-

*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	-0.073	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.040	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	0.000	-	-0.015	-	-	0.001	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.111	-0.118	-	-0.137	-0.134	-0.135	-0.139	-	-0.164	-0.154	-0.166

§ 2/27 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。

2/27 の予定(国内)

8:50 2月上旬の貿易統計(財務省)

2/27 の予定(海外)

米 1月の耐久財受注
2月の消費者信頼感指数

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
3月1日 3ヶ月 第742回	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
3月15日 3ヶ月	3月13日 5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
2月20日 時点の日銀保有残	183,815[億円]
内、2月末までの償還分	-5,794[億円]
02月20日以降の 国庫短期証券 追加買入分	2/21 スタート分 7,502[億円]
現時点の2月末合計額	185,523[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	2月26日	0
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	7 9 15 21 23 28	2月23日	1
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	2 7 13 15 21 26	2月26日	0
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4500億	2 9 19 23 28	2月23日	1
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	1900億	月2回程度	2月26日	0
25年超	500~1,500億程度	800億	月1回	2月19日	0
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	2月26日	0
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	月1回	2月19日	0

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