

DAILY SIGNAL

平成30年3月1日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/1 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%~▲0.030%の水準で取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.060%台後半での出合も見られた。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/1 のオペ結果
	3/1(木)		3/2(金)		3/5(月)		3/6(火)		
券	▲900		▲300		+1,000		+1,000		9:20 ノオベ
財政	▲12,100		▲50,800		▲8,000		+2,000		10:10 ノオベ
過不足	▲13,000		▲51,100		▲7,000		+3,000		11:50 国債補完供給(3/1-3/2) ▲0.600% 全取 1,366億
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				+8,700					13:00 共通担保(全店)<固定金利> (3/5-3/19) 0% 全取 2,320億
国庫短期証券買入									
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)					▲2,300	+2,300			
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲100						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+1,700	▲1,400	+1,400						
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援			▲3,700	+4,000					
貸出増加支援									
当座預金増減	▲12,900		▲40,800		▲7,000		+3,000		
当座預金残高	3,655,100		3,614,300		3,607,300		3,610,300		
準備預金残高	3,208,000		3,207,600		3,207,600		3,207,600		
積み終了先	3,207,600		3,207,600		3,207,600		3,207,600		主な需給要因
超過準備	3,207,600		3,207,600		3,207,600		3,207,600		共通担保(全店) 3,684
非準備先残高	447,100		447,100		447,100		447,100		国債買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		CP買現先 0
平均	50.0%		50.0%		50.0%		50.0%		成長基盤強化 98,295
乖離率	49.9%		49.9%		49.9%		49.9%		被災地金融機関支援 4,921
			予想込増減	▲40,800	予想込増減	▲7,000		+3,000	被災地金融機関支援 4,921
			当預見込	3,614,300	当預見込	3,607,300	当預見込	3,610,300	ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,750,600
3/2以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,800
3/2以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	T/N	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	-0.030	-	-0.100	-0.110
ビッド	-0.065	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

2/28 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,752,700

(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	回数	最高利回	平均利回
3/1	742 (3M)	-0.1944%	-0.2112%
2/22	741 (3M)	-0.1764%	-0.1880%
2/16	740 (1Y)	-0.1607%	-0.1627%

2/28 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	99,706	-4,743	-5,443
	20,824	+700	-
	78,882	-	-

*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	-0.015	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.025	0.020	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.052	0.000	-	-0.028	0.003	-	0.000	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.128	-0.109	-	-0.142	-0.143	-0.149	-0.195	-	-0.168	-0.157	-0.167

§ 3/2 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。

3/2 の予定(国内)

8:30 1月の完全失業率(総務省)

8:50 2月のマネタリベース

10:00 2月28日現在の営業毎旬報告(日銀)

3/2 の予定(海外)

米 2月のシカゴ大消費者信頼感確報

欧 1月の生産者物価

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
3月7日 6ヶ月 第743回	3月6日 30年
3月8日 3ヶ月 第744回	3月13日 5年
3月15日 3ヶ月	3月15日 20年
3月16日 1年	3月27日 40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	-0.030	-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		
2月20日 時点の日銀保有残	183,815[億円]	
内、1月末までの償還分	-26,296[億円]	
02月20日以降の	2/21 スタート分	7,502[億円]
国庫短期証券	2/27 スタート分	2,504[億円]
追加買入分		
現時点の1月末合計額	167,525[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	月2回程度	2月26日	2	
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	7 9 15 21 23 28	2月28日	6	
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億				
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4500億	2 7 13 15 21 26	2月26日	6	
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	1900億				
25年超	500~1,500億程度	700億	2 9 19 23 28	2月28日	5	
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	2月26日	2	
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