

DAILY SIGNAL

平成30年3月2日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 3/2 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.030%の出合から始まった。
その後は▲0.065%~▲0.030%の水準で取引された。
後場では調整程度の出合が見られ引けた。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/2 のオペ結果
	3/2(金)		3/5(月)		3/6(火)		3/7(水)		
券	▲200		+600		+1,000		+0		9:20
財政	▲50,300		▲8,100		+2,000		+5,000		ノオベ
過不足	▲50,500		▲7,500		+3,000		+5,000		10:10
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	国庫短期証券買入(3/6-)
国債買入		+8,700				+10,600			▲0.007% 按分(10.4%)2,502億
国庫短期証券買入						+2,500			国債買入(3/6-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
国債売現先									▲0.002% 按分(70%)2,509億
共通担保(本店)			▲2,300	+2,300					(残存3年超5年以下)
共通担保(全店)									▲0.008% 按分(14.7%)3,306億
CP買現先	▲100		▲300						(残存5年超10年以下)
CP等買入									▲0.011% 按分(88.2%)4,506億
社債等買入									(物価連動債)
ETF買入									+0.040円 按分(89.8%)253億
J-REIT買入									11:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(3/2-3/5)
貸出									▲0.600% 全取 1,461億
国債補完供給	+1,400	▲1,600	+1,600						12:50
米ドル供給用担保国債供給									ノオベ
成長基盤強化支援	▲3,700	+4,000							13:00
貸出増加支援									ノオベ
									13:50
									国債補完供給(3/2-3/5)
									▲0.600% 全取 20億
当座預金増減	▲41,800		▲6,200		+16,100		+5,000		
当座預金残高	3,613,300		3,607,100		3,623,200		3,628,200		
準備預金残高	3,168,700		3,168,500		3,168,500		3,168,500		
積み終了先	3,168,500		3,168,500		3,168,500		3,168,500		
超過準備	3,168,500		3,168,500		3,168,500		3,168,500		
非準備先残高	444,600		444,600		444,600		444,600		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	60.7%		60.7%		60.7%		60.7%		
乖離率	39.2%		39.2%		39.2%		39.2%		
			予想込増減	▲6,200	予想込増減	+16,100		+5,000	
			当預見込	3,607,100	当預見込	3,623,200	当預見込	3,628,200	

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,750,600
3/5 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,300
3/5 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	-0.170
ビッド	-0.065	-	0.000	-0.130
出来値	-	-	-	-

3/1 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,740,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	2/28
長期国債	282	361	430
CP等	2.2	2.3	2.3
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	6.9	11.1	18.3
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	22
その他とも資産計	383	476	533
銀行券	98	102	104
当座預金	253	330	367
その他とも負債・純資産計	383	476	533

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	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%

3/1 のコール市場残高(前日比)

	合計	108,667	+8,961
有担	18,610	-2,214	
無担	90,057	+11,175	

*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	-	-	-0.035	-0.025	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.018	0.050	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.050	0.000	-	-0.028	-0.010	-	-	-	0.180	-	-
東京レボ・レート	-0.111	-0.104	-	-0.143	-0.146	-0.149	-0.191	-	-0.170	-0.157	-0.167

§ 3/5 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。

3/5 の予定(国内)

8:50 3月の当座預金増減要因見込み(日銀)

3/5 の予定(海外)

米 2月のISM非製造業景況指数
欧 1月のユーロ圏小売売上高

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28日 時点の日銀保有残	188,027[億円]	
内、3月末までの償還分	-20,502[億円]	
2月28日以降の国庫短期証券追加買入分	3/6 スタート分 2,502[億円]	
現時点の3月末合計額	170,027[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	3月2日	6	
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	7 9 15 21 23 28	3月2日	5	
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4500億	7 9 15 21 23 28	3月2日	5	
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	1900億	7 9 15 21 23 28	2月28日	4	
25年超	500~1,500億程度	700億	7 9 15 21 23 28	2月28日	4	
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