

DAILY SIGNAL

§ 3/5 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まった。
その後は▲0.07%～▲0.030%の水準で取引された。
同加重平均金利(速報)は前日比▲0.004%の▲0.054%となった。

平成30年3月5日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				3/5 のオペ結果
	3/5(月)		3/6(火)		3/7(水)		3/8(木)		
券	+600		+500		+0		+0		9:20 ノーオペ
財政	▲8,800		+2,000		+6,000		▲2,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲8,200		+2,500		+6,000		▲2,000		11:50 国債補完供給(3/5-3/6) ▲0.600% 全取 217億
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 ノーオペ
国債買入				+10,800					13:00 ノーオペ
国庫短期証券買入				+2,500					13:50 国債補完供給(3/5-3/6) ▲0.600% 全取 3億
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲2,300	+2,300							
CP買現先			▲100						
CP等買入	▲300								
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	+1,600	▲200	+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	▲7,100		+15,900		+6,000		▲2,000		
当座預金残高	3,606,200		3,622,100		3,628,100		3,626,100		
準備預金残高	3,167,600		主な需給予想						
積み終了先	3,167,400								
超過準備	3,167,400								
非準備先残高	438,600								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	64.3%		予想込増減	+15,900	予想込増減	+6,000	▲2,000		共通担保(全店) 3,673
乖離率	35.6%		当預見込	3,622,100	当預見込	3,628,100	当預見込	3,626,100	国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 101,942
									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) 2,750,600
3/6 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,100
3/6 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
オフー	-0.030	-	-0.100	-0.200
ビッド	-0.065	-	0.000	-0.160
出来値	-	-	-	-

3/2 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,699,100

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	16年末実績	17年末実績	2/28
長期国債	361	419	430
CP等	2.3	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	11.1	17.2	18.3
J-REIT	0.36	0.45	0.46
貸出支援基金	41	50	50
国庫短期証券	50	22	22
その他とも資産計	476	521	533
銀行券	102	107	104
当座預金	330	368	367
その他とも負債・純資産計	476	521	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%

3/2 のコール市場残高(前日比)

合計	119,640	+10,973
有担	24,038	+5,428
無担	95,602	+5,545

*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	-0.054	0.000	-	-0.025	0.070	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.117	-0.141	-	-0.147	-0.151	-0.153	-0.195	-	-0.168	-0.157	-0.167

§ 3/6 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。

3/6 の予定(国内)

黒田日銀総裁が参院議員運営
委員会で所信表明

3/6 の予定(海外)

米 NY連銀総裁の講演
1月の製造業受注
ブレイト・FRB理事の講演

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	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			
5年超10年以下	3,000～5,000億程度	4500億	2 7 13 15 21 26	3月2日	5
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	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