

DAILY SIGNAL

平成30年3月12日(月)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 3/12 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まった。
朝方からビッドが薄く、その後は▲0.085%～▲0.04%の水準で取引された。
同加重平均金利(速報)は、前日対比▲0.004%の▲0.065%となった。

(単位:億円)

	日銀速報 3/12(月)		日銀予想 3/13(火)		当社需給予想				3/12 のオペ結果
	3/12(月)		3/13(火)		3/14(水)		3/15(木)		9:20 ノーオペ
券	+1,100		+800		+0		+0		10:10
財政	▲9,100		+2,800		+3,000		▲18,000		国庫短期証券買入(3/14~)
過不足	▲8,000		+3,600		+3,000		▲18,000		+0.007% 按分(40%)7,500億
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	国債買入(3/14~)
国債買入									(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入									▲0.001% 按分(78.9%)4,504億
国債買現先									(残存10年超25年以下)
国債売現先									▲0.003% 按分(2.4%)1,909億
共通担保(本店)									(残存25年超)
共通担保(全店)	▲1,300	+1,200							+0.001% 按分(19.7%)704億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲600		▲300						国債補完供給(3/12-3/13)
社債等買入									▲0.600% 全取 106億
ETF買入		+900							
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+300	▲100	+100						ノーオペ
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	▲7,600		+3,400		+17,600		▲18,000		
当座預金残高	3,640,900		3,644,300		3,661,900		3,643,900		
準備預金残高	3,207,000								主な需給要因
積み終了先	3,206,900								源泉税揚げ
超過準備	3,206,900								国債発行・償還(2年)
非準備先残高	433,900								共通担保(全店)
準備預金進捗率	99.9%								国債買現先
平均	89.3%		予想込増減 +3,400		予想込増減 +17,600		▲18,000		CP買現先
乖離率	10.6%		当預見込 3,644,300		当預見込 3,661,900		当預見込 3,643,900		成長基盤強化
									被災地金融機関支援
									ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,751,400
3/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 300
3/13 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	-0.040	-	-0.100	-0.155
ビッド	-0.080	-	0.000	-0.130
出来値	-	-	-	-

3/9 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,733,000

(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	回数	最高利回	平均利回
3/8	744 (3M)	-0.1824%	-0.1976%
3/7	743 (6M)	-0.1543%	-0.1623%
3/1	742 (3M)	-0.1944%	-0.2112%

3/9 のコール市場残高(前日比)

合計	106,757	-8,259
有担	18,127	-5,976
無担	88,630	-2,283

*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	-0.086	-	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.040	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.065	0.000	-	-0.032	0.005	0.010	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.121	-0.119	-	-0.153	-0.155	-0.199	-0.190	-	-0.174	-0.158	-0.166

§ 3/13 の市場動向予想

足許は▲0.085%~+0.001%のレンジで取引されよう。

3/13 の予定(国内)

8:50 2月の企業物価指数(日銀)
8:50 3月10日現在の営業毎旬報告(日銀)

3/13 の予定(海外)

米 2月の消費者物価

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
3月15日 3ヶ月 第745回	3月13日 5年
3月16日 1年	3月15日 20年
3月22日 3ヶ月	3月27日 40年
4月3日 3ヶ月	3月29日 2年

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]
3/6 スタート分	2,502[億円]
3/14 スタート分	7,500[億円]
現時点の3月末合計	177,527[億円]

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオフー金額	直近オフー額	オフー予定日	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	2 7 14 19 23 30	3月7日	4
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3300億	2 12 14 19 22 30	3月12日	4
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4500億	7 12 16 22 28	3月12日	3
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	1900億	月2回程度	3月2日	1
25年超	500~1,500億程度	700億	月1回	2月19日	1
物価連動債	250億程度	250億			
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億			

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