

DAILY SIGNAL

平成30年1月23日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 1/23 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは325兆9,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.045%の出合からスタート。
その後は▲0.06%～▲0.035%のレンジで出合が見られた。
後場では▲0.06%台で調整程度の取引が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,259,000	3,259,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				1/23 のオペ結果
	1/23(火)		1/24(水)		1/25(木)		1/26(金)		
券	+100		+500		+0		▲1,000		9:20 ノオベ
財政	+1,100		▲9,000		+3,000		+0		10:10 ノオベ
過不足	+1,200		▲8,500		+3,000		▲1,000		10:40 ノオベ
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	11:50 米ドル資金供給(1/25-2/1) 貸付利率 1.920% 1百万米ドル
国債買入		+7,100							11:50 国債補完供給(1/23-1/24) ▲0.500% 全取 1,116億
国庫短期証券買入		+12,500							12:50 ノオベ
国債買現先									13:00 ノオベ
国債売現先									13:50 ノオベ
共通担保(本店)									13:50 国債補完供給(1/23-1/24) ▲0.500% 全取 1億
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲200						
社債等買入			▲100						
ETF買入		+600							+1,300
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+500	▲1,100	+1,100						
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	+20,700		▲7,700		+3,000		+300		
当座預金残高	3,676,500		3,668,800		3,671,800		3,672,100		
準備預金残高	3,251,600								
積み終了先	3,249,100								
超過準備	3,248,600								
非準備先残高	424,900								
準備預金進捗率	99.5%								
平均	25.8%		予想込増減 ▲7,700		予想込増減 +3,000		+300		
乖離率	73.7%		当預見込 3,668,800		当預見込 3,671,800		当預見込 3,672,100		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,066.300
1/24以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 16,300
1/24以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 700

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.035	-	-0.100	-0.085
ビッド	-0.045	-	0.000	-0.075
出来値	-	-	-	-

1/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,738,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	1/20
長期国債	282	361	421
CP等	2.2	2.3	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	17.4
J-REIT	0.27	0.36	0.45
貸出支援基金	31	41	50
国庫短期証券	43	50	24
その他とも資産計	383	476	525
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	525

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
1/18	734 (3M)	-0.1443%	-0.1559%
1/17	733 (1Y)	-0.1371%	-0.1401%
1/11	732 (3M)	-0.1162%	-0.1251%

1/22 のコール市場残高(前日比)

	合計	100,736	-777
有担	23,478	-114	
無担	77,258	-663	

*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	-0.070	-	-	-0.033	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.041	0.000	-	-0.022	-0.010	-	0.001	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.082	-0.078	-	-0.085	-0.088	-0.092	-0.094	-	-0.119	-0.144	-0.157

§ 1/24 の市場動向予想

足許は▲0.07～+0.001%のレンジで取引されよう。

1/24 の予定(国内)

8:50 12月の貿易統計(財務省)
11月の景気動向指数改訂値(内閣府)
1月の経済・物価情勢の展望[全文](日銀)

1/24 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
12月の中古住宅販売件数
1月の製造業PMI・サービス業PMI速報

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
1月25日 3ヶ月 第735回	1月25日 20年
2月1日 3ヶ月	1月30日 2年
2月7日 6ヶ月	2月1日 10年
2月8日 3ヶ月	2月6日 物価連動

翌営業日の出合いレンジ予想									
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
-0.070	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.030	-0.020	-0.010	-0.010	
~	~	~	~	~	~	~	~	~	
0.001	0.001	0.030	0.030	0.030	0.040	0.050	0.080	0.100	

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
1月19日 時点の日銀保有残	196,376[億円]
内、1月末までの償還分	-24,737[億円]
01月19日以降の国庫短期証券追加買入分	1/23 スタート分 12,501[億円]
現時点の1月末合計額	184,140[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	1月17日	1
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	4 11 17 24 26 31	1月17日	3
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3000億	4 11 15 19 24 29	1月19日	2
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4100億	4 11 15 19 24 29	1月19日	2
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	1900億	4 11 15 19 24 29	1月19日	2
25年超	500~1,500億程度	800億	4 11 15 19 24 29	1月19日	2
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	1月9日	1
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	-	12月15日	-

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