

DAILY SIGNAL

平成29年11月13日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは323兆7,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.045%の出合からスタート。
先週末と比べて落ち着いた地合となり、
▲0.060～▲0.040%のレンジで取引された。
同加重平均金利は前日比▲0.004%の▲0.048%となった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,237,000	3,237,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/13 のオペ結果
	11/13(月)		11/14(火)		11/15(水)		11/16(木)		
券	+1,100		+400		+0		+0		9:20 ノオペ
財政	▲20,400		▲1,600		▲2,000		▲27,000		10:10 ノオペ
過不足	▲19,300		▲1,200		▲2,000		▲27,000		11:50 ノオペ
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 ノオペ
国債買入				+7,300					13:00 ノオペ
国庫短期証券買入				+1,000					ノオペ
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲1,300	+1,300							
CP買現先				▲100					
CP等買入	▲100								
社債等買入									
ETF買入		+100		+500					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+200	▲300	+300						
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	▲19,400		+7,800		▲2,000		▲27,000		
当座預金残高	3,669,100		3,676,900		3,674,900		3,647,900		
準備預金残高	3,243,600		3,243,500		3,243,500		3,243,500		
積み終了先	3,243,500		3,243,500		3,243,500		3,243,500		
超過準備	3,243,500		3,243,500		3,243,500		3,243,500		
非準備先残高	425,500		425,500		425,500		425,500		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%		100.0%		
平均	93.5%		93.5%		93.5%		93.5%		
乖離率	6.5%		6.5%		6.5%		6.5%		
主な需給要因			源泉税揚げ		国債発行・償還(2年)		国債発行(5年)		
共通担保(全店)									2,979
国債買現先									0
CP買現先									0
成長基盤強化									92,686
被災地金融機関支援									5,088
ロンハート残高									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,031,300
11/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0
11/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 0

	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	-0.090
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.075
出来値	-	-	-	-

11/10 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,748,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	10/31
長期国債	282	361	412
CP等	2.2	2.3	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	16.1
J-REIT	0.27	0.36	0.44
貸出支援基金	31	41	48
国庫短期証券	43	50	29
その他とも資産計	383	476	518
銀行券	98	102	102
当座預金	253	330	370
その他とも負債・純資産計	383	476	518

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
11/9	720 (3M)	-0.2549%	-0.2780%
11/8	719 (6M)	-0.2276%	-0.2376%
11/1	718 (3M)	-0.1842%	-0.1897%

11/10 のコール市場残高(前日比)

	合計	104,094	+4,978
有担	18,857	-34	
無担	85,237	+5,012	

*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	-	-	-0.028	-0.035	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	-	-	-0.018	-0.023	-0.035	0.050	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.101	-0.093	-	-0.118	-0.120	-0.124	-0.127	-	-0.143	-0.150	-0.166

§ 11/14 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。

11/14 の予定(国内)

10:00 日銀営業毎旬報告(11月10日現在)

11/14 の予定(海外)

ユーロ圏 GDP改定値(7～9月)

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
11月15日 1年 第721回	11月14日 5年
11月16日 3ヶ月 第722回	11月16日 20年
11月22日 3ヶ月	11月28日 40年
11月30日 3ヶ月	11月30日 2年

翌営業日の出合いレンジ予想										
ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y		
-0.070	-0.045	-0.045	-0.045	-0.045	-0.035	-0.030	-0.010	-0.010		
~	~	~	~	~	~	~	~	~		
0.001	0.001	0.001	0.001	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20兆円台前半
10月31日 時点の日銀保有残	230,411[億円]
内、11月末までの償還分	-47,763[億円]
10月31日以降の	
国庫短期証券	11/7 スタート分 1,000[億円]
追加買入分	11/14 スタート分 1,000[億円]
現時点の11月末合計額	184,648[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	500～1,500億程度	700億	月2回程度	11月6日	1
1年超3年以下	2,000～3,000億程度	2800億	6 8 15 17 22 27	11月8日	4
3年超5年以下	2,500～3,500億程度	3000億	2 8 10 15 22 29	11月10日	3
5年超10年以下	3,000～5,000億程度	4100億	2 8 10 15 22 29	11月10日	3
10年超25年以下	1,500～2,500億程度	2000億	2 10 17 24 29	11月10日	3
25年超	500～1,500億程度	1000億	月2回程度	11月6日	1
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	11月6日	1
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	-	10月18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