

DAILY SIGNAL

平成29年11月15日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは326兆7,000億円だった。
積み最終日となる本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合からスタート。
その後、▲0.060～▲0.035%のレンジで取引された。
午後にかけて調整の調達が見られ、▲0.03%台前半での出合も見られた。
同加重平均金利は前日比+0.003%の▲0.045%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	3,267,000	3,267,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/15 のオペ結果
	11/15(水)		11/16(木)		11/17(金)				
券	+300		▲800		▲1,000				9:20 ノオペ
財政	▲2,800		▲25,300		+1,000				10:10 国債買入(11/17-)
過不足	▲2,500		▲26,100		+0				(残存1年超3年以下)
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	▲0.004% 按分(97.8%)2,801億
国債買入						+9,900			(残存3年超5年以下)
国庫短期証券買入									▲0.007% 按分(83.2%)3,005億
国債買現先									(残存5年超10年以下)
国債売現先									▲0.004% 按分(23.1%)4,112億
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)									国債補完供給(11/15-11/16)
CP買現先									▲0.500% 全取 15億
CP等買入	▲700		▲100						12:50
社債等買入									ノオペ
ETF買入		+200							13:00
J-REIT買入									ノオペ
被災地金融機関支援									13:50
貸出									国債補完供給(11/15-11/16)
国債補完供給	+200	▲100	+100						▲0.500% 全取 44億
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	▲2,900		▲26,100		+9,900				▲29,400
当座預金残高	3,673,200		3,647,100		3,657,000				3,627,600
準備預金残高	3,269,900		3,269,900		3,269,900				3,269,900
積み終了先	3,269,900		3,269,900		3,269,900				3,269,900
超過準備	3,269,900		3,269,900		3,269,900				3,269,900
非準備先残高	403,300		403,300		403,300				403,300
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%				100.0%
平均	100.0%		100.0%		100.0%				100.0%
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%				0.0%
主な需給要因			国債発行(5年)				国庫短期証券発行・償還(3M・1Y)		共通担保(全店) 2,979
							国債発行(20年)		国債買現先 0
							国債償還(変動15年)		CP買現先 0
							国債償還(変動15年)		成長基盤強化 92,686
							国債償還(変動15年)		被災地金融機関支援 5,088
							国債償還(変動15年)		ロンハート残高 0
予想込増減	▲26,100		▲26,100		+9,900		▲29,400		
当預見込	3,647,100		3,647,100		3,657,000		3,627,600		

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,946,200
11/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,946,200
11/16 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 98,200

	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
ビッド	-0.055	0.000
出来値	-	-

11/14 時点のマネタリベース(単位:億円) 4,734,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	11/10
長期国債	282	361	415
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	27
その他とも資産計	383	476	520
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	369
その他とも負債・純資産計	383	476	520

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
11/15	721 (1Y)	-0.1936%	-0.2145%
11/9	720 (3M)	-0.2549%	-0.2780%
11/8	719 (6M)	-0.2276%	-0.2376%

11/14 のコール市場残高(前日比)

	合計	104,189	+5,854
有担	23,240	+859	
無担	80,949	+4,995	

*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	-0.060	-	-	-0.040	-0.040	-	-0.045	-	-	-	-
最高	0.020	-	-	0.001	0.000	-	-0.020	-	-	-	-
加重平均	-0.045	-	-	-0.033	-0.024	-	-0.037	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.092	-0.095	-	-0.112	-0.117	-0.119	-0.123	-	-0.139	-0.148	-0.164

§ 11/16 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。

11/16 の予定(国内)

17:00 業態別の日銀当座預金残高(10月)

11/16 の予定(海外)

米 フェデラルリザーブ議事録
週間新規失業保険申請件数
ダウ連銀総裁の講演

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
11月16日 3ヶ月 第722回	11月16日 20年
11月22日 3ヶ月 第723回	11月28日 40年
11月30日 3ヶ月	11月30日 2年
12月6日 6ヶ月	12月5日 10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
11月10日 時点の日銀保有残	214,756[億円]
内、11月末までの償還分	-31,108[億円]
11月10日以降の国庫短期証券追加買入分	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15日	3
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3000億	2 8 10 15 22 29	11月15日	2
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4100億	2 10 17 24 29	11月10日	3
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	2000億	月2回程度	11月6日	1
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