DAILY SIGNAL

平成29年11月20日(月)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 11/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは318兆7,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.05%の出合からスタート。
その後、▲0.078～▲0.035%のレンジで取引された。
同加重平均金利は前日比+0.001%の▲0.047%となった。

	即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
8:00	－	－	3,187,000	3,187,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想			
	11/20(月)		11/21(火)		11/22(水)		11/24(金)	
券	+0		▲1,100		▲2,000		▲1,000	
財政	▲28,300		+1,200		▲1,000		▲5,000	
過不足	▲28,300		+100		▲3,000		▲6,000	
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				+8,600				
国庫短期証券買入				+5,000				
国債買現先								
国債売現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)	▲1,400	+2,400						
CP買現先								
CP等買入	▲500			+2,000				
社債等買入			▲200					
ETF買入		+100		+200				
J－REIT買入								
被災地金融機関支援貸出								
国債補完供給		▲100	+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		▲27,800		+15,800		▲3,000		▲6,000
当座預金残高		3,625,800		3,641,600		3,638,600		3,632,600
準備預金残高		3,189,900	主な需給要因					
積み終了先		3,184,900						
超過準備		3,175,400						
非準預先残高		435,900						
準備預金進捗率		99.2%						
平均		16.7%	予想込増減	+15,800	予想込増減	▲3,000	予想込増減	▲6,000
乖離率		82.5%	当預見込	3,641,600	当預見込	3,638,600	当預見込	3,632,600

11/20 のオペ結果

9:20
ノーオペ
10:10
ノーオペ
11:50
国債補完供給(11/20-11/21)
▲0.500% 全取 104億

12:50
ノーオペ
13:00
ノーオペ

共通担保(全店)	3,989
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
ロンバート残高	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,946,200
11/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 23,800
11/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,000

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オファー	−0.035	－	−0.100	−0.115
ビッド	−0.050	－	0.000	−0.100
出来値	－	－	－	－

11/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,713,800

(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
11/16	722 (3M)	-0.2270%	-0.2382%
11/15	721 (1Y)	-0.1936%	-0.2145%
11/9	720 (3M)	-0.2549%	-0.2780%

11/17 のコール市場残高(前日比)

合計	107,627	+5,463
有担	22,433	+381
無担	85,194	+5,082

*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	−0.078	−0.010	－	−0.040	－	－	－	－	－	－	－
最高	0.001	0.000	－	−0.025	－	－	－	－	－	－	－
加重平均	−0.047	−0.002	－	−0.032	−0.015	−0.035	−0.025	－	0.000	－	－
東京レポ・レート	−0.100	−0.102	－	−0.115	−0.123	−0.124	−0.128	－	−0.139	−0.148	−0.164

§ 11/21 の市場動向予想

足許は▲0.08～+0.001%のレンジで取引されよう。

11/21 の予定(国内)
13:30 9月の全産業活動指数(経産省)

11/21 の予定(海外)
米 10月のｼｶｺﾞ連銀全米活動指数

国庫短期証券入札予定		国債入札予定	
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
12月7日	3ヶ月	12月7日	30年

翌営業日の出合いレンジ予想

ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
−0.080	−0.045	−0.045	−0.045	−0.045	−0.025	−0.025	−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	11/14 スタート分	1,000[億円]
	11/21 スタート分	5,002[億円]
現時点の11月末合計額		189,650[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	2500億	6 8 15 17 22 27	11月17日	2
3年超5年以下	2,500～3,500億程度	3000億			
5年超10年以下	3,000～5,000億程度	4100億	2 8 10 15 22 29	11月15日	2
10年超25年以下	1,500～2,500億程度	2000億	2 10 17 24 29	11月17日	2
25年超	500～1,500億程度	1000億			
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