

DAILY SIGNAL

平成29年11月24日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは319兆4,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.05%の合出から始まった。
その後、▲0.065～▲0.04%のレンジで取引された。
後場に入ると、▲0.075～▲0.07%のレンジで調整程度の出が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,194,000	3,194,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/24 のオペ結果
	11/24(金)		11/27(月)		11/28(火)		11/29(水)		
券	▲700		▲100		▲1,000		▲1,000		9:20 ノオペ
財政	▲3,200		▲2,500		▲1,000		▲2,000		10:10 国庫短期証券買入(11/28-)
過不足	▲3,900		▲2,600		▲2,000		▲3,000		+0.004% 按分(24.6%)2,501億
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(11/28-)
国債買入				+9,700		+3,200			(残存10年超25年以下)
国庫短期証券買入						+2,500			+0.011% 按分(42.8%)2,008億
国債買現先									(残存25年超)
国債売現先									+0.019% 按分(19.9%)902億
共通担保(本店)			▲1,300	+2,200					(物価連動債)
共通担保(全店)									▲0.100円 按分(11.3%)252億
CP買現先			▲300						11:50
CP等買入	▲300		▲300						国債補完供給(11/24-11/27)
社債等買入	▲200		▲100			+800			▲0.600% 全取 171億
ETF買入		+100		+600					12:50
J-REIT買入									ノオペ
被災地金融機関支援									13:00
貸出									ノオペ
国債補完供給		▲200	+200						
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	▲4,500		+8,400		+4,500		▲3,000		
当座預金残高	3,629,100		3,637,500		3,642,000		3,639,000		
準備預金残高	3,192,600		3,191,600		3,191,100		436,500		
積み終了先	3,191,600		3,191,100		436,500				
超過準備	3,191,100		436,500						
非準備先残高	436,500								
準備預金進捗率	99.7%		36.7%		36.7%		36.7%		
平均	36.7%		36.7%		36.7%		36.7%		
乖離率	63.0%		63.0%		63.0%		63.0%		
主な需給要因			国庫短期証券発行・償還(3M)						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 5,087
									ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,946,200
11/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 8,500
11/27 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.040	-	-0.100	-0.110
ビッド	-0.055	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

11/22 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,697,100**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	11/20
長期国債	282	361	416
CP等	2.2	2.3	2.1
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	16.3
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	25
その他とも資産計	383	476	518
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	363
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
11/22	723 (3M)	-0.2456%	-0.2538%
11/16	722 (3M)	-0.2270%	-0.2382%
11/15	721 (1Y)	-0.1936%	-0.2145%

11/22 のコール市場残高(前日比)

	合計	98,079	+1,456
有担	22,673	+2,659	
無担	75,406	-1,203	

*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	-0.075	-	-	-0.045	-0.040	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.040	-0.028	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	0.000	-	-0.044	-0.034	-	0.000	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.101	-0.099	-	-0.123	-0.122	-0.124	-0.126	-	-0.138	-0.149	-0.164

§ 11/27 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。

11/27 の予定(国内)

8:50 10月の企業向けサービス価格(日銀)

11/27 の予定(海外)

米 10月の新築住宅販売件数
NY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30日 3ヶ月 第724回	11月28日 40年
12月6日 6ヶ月	11月30日 2年
12月7日 3ヶ月	12月5日 10年
12月14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	-0.025	-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20日 時点の日銀保有残	187,550[億円]
内、11月末までの償還分	-2,902[億円]
11月20日以降の	11/21 スタート分 5,002[億円]
国庫短期証券	11/28 スタート分 2,501[億円]
追加買入分	
現時点の11月末合計額	192,151[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22日	0
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3000億	2 8 10 15 22 29	11月22日	1
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4100億	2 8 10 15 22 29	11月22日	1
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	2000億	2 10 17 24 29	11月24日	1
25年超	500~1,500億程度	900億	月2回程度	11月24日	0
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	11月24日	0
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