

DAILY SIGNAL

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

§ 11/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは322兆6,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.055%の出合からスタート。
その後は、▲0.070～▲0.045%のレンジで取引された。
後場でも水準に変化はなく、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,226,000	3,226,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/29 のオペ結果
	11/29(水)		11/30(木)		12/1(金)		12/4(月)		
券	▲900		▲1,400		▲2,000		▲1,000		9:20 ノオペ
財政	▲5,300		+2,500		▲8,000		▲78,000		10:10 ノオペ
過不足	▲6,200		+1,100		▲10,000		▲79,000		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	11:50 ノオペ
国債買入		+6,100				+7,000			12:50 ノオペ
国庫短期証券買入									13:00 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)							▲2,400		
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲1,300	+2,000					
社債等買入	▲200								
ETF買入		+900		+800					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給		▲200	+200						
米ドル供給用担保国債供給					▲600	+6,200			
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+200		+2,800		+2,600		▲81,400		
当座預金残高	3,646,000		3,648,800		3,651,400		3,570,000		
準備預金残高	3,227,600								
積み終了先	3,227,100								
超過準備	3,227,100								
非準備先残高	418,400								
準備預金進捗率	99.8%								
平均	46.7%		予想込増減 +2,800		予想込増減 +2,600		▲81,400		
乖離率	53.1%		当預見込 3,648,800		当預見込 3,651,400		当預見込 3,570,000		

9:20
ノオペ
10:10
ノオペ
11:50
ノオペ
12:50
ノオペ
13:00
ノオペ

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,946.300
11/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,700
11/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 400

	T/N	ユーロ円	T+2	CP現先	レボG.C
オファー	-0.040	-	-0.100	-0.105	-
ビッド	-0.055	-	0.000	-0.090	-
出来値	-	-	-	-	-

11/28 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,710,900

(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%

11/28 のコール市場残高(前日比)

	合計	100,957	+3,825
有担	24,164	+1,653	
無担	76,793	+2,172	

*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	-	-	-0.040	-0.040	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.035	0.000	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	0.000	-	-0.040	-0.035	-	-0.045	-	0.050	-	-
東京レボ・レート	-0.098	-0.098	-	-0.112	-0.113	-0.116	-0.154	-	-0.139	-0.150	-0.165

§ 11/30 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。

11/30 の予定(国内)

原田日銀審議委員が福島県金融経済懇談会であいさつ
17:00 当面の長期国債等の買入れ運営について(日銀)

11/30 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数
欧 11月のCPI速報
10月の失業率

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30日 2年
12月6日 6ヶ月 第725回	12月5日 10年
12月7日 3ヶ月	12月7日 30年
12月14日 3ヶ月	12月12日 5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	-0.035	-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	500億	月2回程度	11月27日	0
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	6 8 15 17 22 27	11月27日	0
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29日	0
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	2000億			
25年超	500~1,500億程度	900億	2 10 17 24 29	11月29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