

DAILY SIGNAL

平成29年12月14日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/14 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは319兆5,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.02%の出合から始まった。
その後は▲0.04～▲0.02%のレンジで出合が見られた。
後場では▲0.03%台で調整程度の出合が見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,195,000	3,195,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/14 のオペ結果
	12/14(木)		12/15(金)		12/18(月)		12/19(火)		
券	▲2,800		▲2,500		▲3,000		▲4,000		9:20 ノオベ
財政	+2,400		+53,700		▲3,000		+4,000		10:10 ノオベ
過不足	▲400		+51,200		▲6,000		+0		10:40 ノオベ
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	10:40 CP等買入(12/19-)
国債買入				+9,700					▲0.006% 按分(72.9%) 4,490億
国庫短期証券買入									11:50 国債補完供給(12/14-12/15)
国債買現先									▲0.500% 全取 324億
国債売現先									12:50 ノオベ
共通担保(本店)					▲2,500	+4,100			13:00 共通担保(全店)<固定金利>
共通担保(全店)									(12/18-1/4)
CP買現先									0% 全取 4,112億
CP等買入	▲100		▲500						13:50 国債補完供給(12/14-12/15)
社債等買入	▲100		▲200						▲0.500% 全取 7億
ETF買入		+200		+200					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+300	▲300	+300						
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援				▲14,500	+28,900				
貸出増加支援									
当座預金増減	▲400		+75,100		▲4,400		+4,500		
当座預金残高	3,608,400		3,683,500		3,679,100		3,683,600		
準備預金残高	3,195,800		3,195,800		3,195,800		3,195,800		
積み終了先	3,195,800		3,195,800		3,195,800		3,195,800		
超過準備	3,195,700		3,195,700		3,195,700		3,195,700		
非準備先残高	412,600		412,600		412,600		412,600		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		
平均	96.7%		96.7%		96.7%		96.7%		
乖離率	3.2%		3.2%		3.2%		3.2%		
			予想込増減	+75,100	予想込増減	▲4,400	予想込増減	+4,500	
			当預見込	3,683,500	当預見込	3,679,100	当預見込	3,683,600	
									主な需給要因
									年金定時払い
									国債発行・償還(2年)
									国庫短期証券発行・償還(3M)
									共通担保(全店) 5,803
									国債買現先 0
									CP買現先 0
									成長基盤強化 98,295
									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) 2,950,300
12/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100
12/15 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.020	-	-0.100	-0.110
ビッド	-0.040	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

12/13 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,690,900**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	12/10
長期国債	282	361	421
CP等	2.2	2.3	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	16.7
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	525
銀行券	98	102	103
当座預金	253	330	360
その他とも負債・純資産計	383	476	525

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
12/14	727 (3M)	-0.1786%	-0.1954%
12/7	726 (3M)	-0.1414%	-0.1522%
12/6	725 (6M)	-0.1382%	-0.1442%

12/13 のコール市場残高(前日比)

	合計	92,251	+2,713
有担	21,072	-394	
無担	71,179	+3,107	

*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	-0.040	-	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.026	0.000	-	-0.033	-0.045	0.060	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.044	-0.073	-	-0.100	-0.174	-0.155	-0.151	-	-0.126	-0.150	-0.164

§ 12/15 の市場動向予想

足許は▲0.04～+0.001%のレンジで取引されよう。

12/15 の予定(国内)

8:50 12月調査の短観・概要(日銀)

12/15 の予定(海外)

米 12月のNY連銀製造業景況感指数
11月の鉱工業生産

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
12月18日 1年 第728回	12月26日 2年
12月20日 3ヶ月 第729回	1月10日 10年
1月5日 3ヶ月	1月12日 40年
1月10日 6ヶ月	1月16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		
-0.040	-0.040	-0.025	-0.025	-0.025	-0.025	-0.025	-0.010	-0.010		
~	~	~	~	~	~	~	~	~		
0.001	0.001	0.030	0.030	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10兆円台後半から20兆円台前半
12月8日 時点の日銀保有残	195,591[億円]
内、12月末までの償還分	-40,279[億円]
12月08日以降の国庫短期証券追加買入分	12/12 スタート分 12,502[億円]
現時点の12月末合計額	167,814[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	100~1,000億程度	500億	月2回程度	12月6日	1
1年超3年以下	2,000~3,000億程度	2500億	1 8 13 18 20 27	12月13日	3
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3000億	1 6 13 18 25 28	12月13日	3
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4100億	1 6 13 18 25 28	12月8日	4
10年超25年以下	1,500~2,500億程度	2000億	1 6 13 18 25 28	12月1日	1
25年超	500~1,500億程度	900億	月2回程度	12月1日	1
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	10月18日	1
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	月1回	10月18日	1

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