

DAILY SIGNAL

平成29年12月22日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは328兆5,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まった。
その後は主に▲0.06～▲0.04%の水準で出合が見られた。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06%台半ばの出合も見られた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	3,285,000	3,285,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/22 のオペ結果
	12/22(金)		12/25(月)		12/26(火)		12/27(水)		
券	▲3,700		▲2,300		▲3,000		▲3,000		9:20 ノオペ 10:10 国庫短期証券買入(12/26-) +0.003% 按分(96.7%) 10,001億 11:50 国債補完供給(12/22-12/25) ▲0.500% 全取 352億 12:50 ノオペ 13:00 ノオペ
財政	▲300		▲9,000		▲6,000		+4,000		
過不足	▲4,000		▲11,300		▲9,000		+1,000		
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						+10,000			
国債買現先									
国債売現先									
共通担保(本店)			▲3,100	+5,200					
共通担保(全店)									
CP買現先			▲1,100						
CP等買入	▲1,000		▲100	+1,500					
社債等買入	▲100		▲100	+300					
ETF買入		+700							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援	▲100	+100							
貸出									
国債補完供給	+2,800	▲400	+400						
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	+6,600		▲8,200		+1,000		+1,000		
当座預金残高	3,704,100		3,695,900		3,696,900		3,697,900		
準備預金残高	3,280,900								
積み終了先	3,279,600								
超過準備	3,277,900								
非準備先残高	423,200								
準備預金進捗率	99.8%								
平均	29.0%		予想込増減 ▲8,200		予想込増減 +1,000		+1,000		
乖離率	70.8%		当預見込 3,695,900		当預見込 3,696,900		当預見込 3,697,900		

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,048,200
12/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,300
12/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 300

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-0.030	-	-0.100	-0.100
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

12/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,796,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	12/20
長期国債	282	361	416
CP等	2.2	2.3	2.5
社債等	3.2	3.2	3.0
ETF	6.9	11.1	17.0
J-REIT	0.27	0.36	0.44
貸出支援基金	31	41	50
国庫短期証券	43	50	22
その他とも資産計	383	476	519
銀行券	98	102	105
当座預金	253	330	371
その他とも負債・純資産計	383	476	519

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
12/20	729 (3M)	-0.1751%	-0.1881%
12/18	728 (1Y)	-0.1497%	-0.1547%
12/14	727 (3M)	-0.1786%	-0.1954%

12/21 のコール市場残高(前日比)

	合計	110,359	+515
有担	24,355	+1,638	
無担	86,004	-1,123	

*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	-0.065	-0.030	-	-0.045	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.044	-0.005	-	-0.043	-	-	0.020	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.091	-0.088	-	-0.167	-0.145	-0.134	-0.123	-	-0.128	-0.147	-0.161

§ 12/25 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。

12/25 の予定(国内)

14:00 10月の景気動向指数改訂値(内閣府)

12/25 の予定(海外)

米 株式・債券市場休場

国庫短期証券入札予定	国債入札予定
1月5日 3ヶ月	12月26日 2年
1月10日 6ヶ月	1月10日 10年
1月11日 3ヶ月	1月12日 40年
1月17日 1年	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		
-0.070	-0.020	-0.020	-0.020	-0.020	-0.015	-0.015	-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20日 時点の日銀保有残	179,975[億円]
内、12月末までの償還分	-9,661[億円]
12月20日以降の国庫短期証券追加買入分	12/26 スタート分 10,001[億円]
現時点の12月末合計額	180,315[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20日	1
3年超5年以下	2,500~3,500億程度	3000億	1 6 13 18 25 28	12月18日	2
5年超10年以下	3,000~5,000億程度	4100億	8 15 20 25 28	12月20日	2
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			
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	12月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	月1回	12月15日	0

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