

DAILY SIGNAL

平成28年12月16日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/16 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは248兆7,000億円だった。
積み初日となる本日の無担保コールON物は、朝方▲0.03%の出会いからスタートし、
▲0.055～▲0.025%のレンジで取引された。
後場に入っても地合いは変わらず、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	-	-	2,487,000	+2,487,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/16 のオペ結果
	12/16(金)		12/19(月)		12/20(火)		12/21(水)		
券	▲3,100		▲2,600		▲4,000		▲5,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(12/20-) (残存1年以下) ▲0.010%按分(91.7%) 704億 (残存10年超25年以下) ▲0.009%按分(80.0%) 2,001億 (残存25年超) ▲0.012%按分(7.1%) 1,204億 10:40 社債等買入(12/22-) ▲0.145%按分(26.7%) 1,250億 11:50 国債補完供給(12/16-12/19) ▲0.500% 全取 158億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補完供給(12/16-12/19) ▲0.500% 全取 9億 共通担保(本店) 0 共通担保(全店) 3,770 国債買現先 0 CP買現先 0 成長基盤強化 76,205 被災地金融機関支援 5,052 ロンハート残高 0
財政	+3,300		▲4,000		+60,000		+2,000		
過不足	+200		▲6,600		+56,000		▲3,000		
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		+16,300				+3,900			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)			▲1,500	+1,600					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲200	+4,500	▲300						
社債等買入									
ETF買入		+500							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+300	▲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	+21,400		▲6,600		+59,900		▲3,000		
当座預金残高	3,259,900		3,253,300		3,313,200		3,310,200		
準備預金残高	2,926,800		2,406,000		ノオベ		ノオベ		
積み終了先	2,406,000		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
超過準備	1,768,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
非準備先残高	333,100		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
準備預金進捗率	96.4%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
平均	9.7%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
乖離率	86.8%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		
予想込増減	▲6,600		▲6,600		+59,900		▲3,000		
当預見込	3,253,300		3,253,300		3,313,200		3,310,200		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,198,900
12/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 78,500
12/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,800

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.025	-
レボ	-0.050	-
出戻	-	-

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	12/10
長期国債	202	282	362
CP等	2.2	2.2	2.6
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	10.8
J-REIT	0.18	0.27	0.35
貸出支援基金	25	31	36
国庫短期証券	49	43	53
その他とも資産計	300	383	476
銀行券	93	98	99
当座預金	178	253	313
その他とも負債・純資産計	300	383	476

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
12/16	653(1Y)	-0.3000%	-0.3388%
12/15	652(3M)	-0.3925%	-0.4196%
12/8	651(3M)	-0.3903%	-0.4032%

12/15 のコール市場残高(前日比)		
合計	91,752	-3,072
有担	20,047	+532
無担	71,705	-3,604

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

12/15 時点のマナターベース(単位:億円) 4,279,900

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	-	-	-0.035	-0.035	-	-0.030	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-0.005	-	0.000	-	-	-	-
加重平均	-0.037	0.010	-	-0.031	-0.027	0.010	-0.026	-	-	-	-
東京レボレート	-0.090	-0.090	-	-0.100	-0.174	-0.162	-0.155	-	-0.150	-0.225	-0.228

§ 12/19 オファのオペと市場動向予想

足許は▲0.07～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノオベを予想する。

12/19 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合(20日まで)
国債投資家懇談会(財務省)

12/19 の予定(海外)

独 IFO景況感指数(12月)

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想									
即日オペ金額	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノオベ	▲6,600	3,253,300	+3,253,300	-0.070	-0.030	-0.030	-0.010	-0.010	-0.010	-0.020	-0.030	
				~	~	~	~	~	~	~	~	~	
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	

共通担保資金供給(全店)					*当日物					共通担保資金供給(本店)					*当日物				
期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	札割れ	2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	-	札割れ				
2016/12/12 ~ 2016/12/28	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	-	札割れ	2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ				
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24				
2016/11/28 ~ 2017/3/6	5,000	100	100	0.00%	固定金利	-	札割れ	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70				
2016/11/28 ~ 2016/12/12	8,000	2,851	2,851	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/11/21 ~ 2016/12/5	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率				
2016/11/14 ~ 2016/11/28	8,000	1,901	1,901	0.00%	固定金利	-	札割れ	12/15 ~ 12/22	担保範囲内	403	403	1.080%	固定金利	-	1.00				
2016/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	0.00%	固定金利	-	札割れ	12/8 ~ 12/15	担保範囲内	11	11	0.890%	固定金利	-	1.00				

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ありません。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