

DAILY SIGNAL

平成28年11月18日(金)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは238兆3,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出合から始まり、
その後は▲0.065～▲0.03%のレンジで取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.07%近辺の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,383,000	+2,383,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/18 のオペ結果
	11/18(金)		11/21(月)		11/22(火)		11/24(木)		
券	▲1,200		▲500		▲1,000		▲1,000		9:20
財政	+1,000		▲33,600		+2,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲200		▲34,100		+1,000		+1,000		10:10
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	国庫短期証券買入(11/22-)
国債買入		+12,600				+11,200			+0.039%按分(90.7%) 15,000億
国庫短期証券買入						+15,000			国債買入(11/22-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)			▲1,400	+1,500					+0.007%按分(83.6%) 4,005億
共通担保(全店)									(残存3年超5年以下)
CP買現先									+0.020%按分(98.1%) 4,204億
CP等買入	▲300	+3,000	▲500						(残存10年超25年以下)
社債等買入									+0.022%按分(54.9%) 1,903億
ETF買入		+300							(残存25年超)
J-REIT買入									+0.011%按分(100.0%) 1,102億
被災地金融機関支援									10:40
貸出									社債等買入(11/25-)
国債補完供給	+100	▲300	+300						▲0.175%按分(33.3%) 1,000億
米ドル供給用担保国債供給									11:50
成長基盤強化支援									国債補完供給(11/18-11/21)
貸出増加支援									▲0.500%全取 314億
当座預金増減	+15,200		▲34,200		+27,200		+1,000		12:50
当座預金残高	3,153,100		3,118,900		3,146,100		3,147,100		ノーオペ
準備預金残高	2,835,200		2,374,500		2,374,500		2,374,500		13:00
積み終了先	2,374,500		2,374,500		2,374,500		2,374,500		ノーオペ
超過準備	2,334,500		2,334,500		2,334,500		2,334,500		共通担保(本店)
非準備先残高	317,900		317,900		317,900		317,900		共通担保(全店)
準備預金進捗率	98.7%		98.7%		98.7%		98.7%		国債買現先
平均	16.7%		16.7%		16.7%		16.7%		CP買現先
乖離率	82.0%		82.0%		82.0%		82.0%		成長基盤強化
			予想込増減	▲34,200	予想込増減	+27,200	予想込増減	+1,000	被災地金融機関支援
			当預見込	3,118,900	当預見込	3,146,100	当預見込	3,147,100	ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,111.300
11/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 28.400
11/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1.100

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.030	-
レボ	-0.100	-0.115
ビッド	-0.050	-
出来値	-	0.000
	-	-0.095

11/17 時点のマナターベース(単位:億円) 4,150,600

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	11/10
長期国債	202	282	352
CP等	2.2	2.2	2.0
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	10.3
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	54
その他とも資産計	300	383	465
銀行券	93	98	97
当座預金	178	253	315
その他とも負債・純資産計	300	383	465

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
11/17	647(3M)	-0.2716%	-0.2891%
11/16	646(1Y)	-0.2500%	-0.2749%
11/10	645(3M)	-0.2661%	-0.2765%

11/17 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	89,260	19,477	69,783
	+8,475	+675	+7,800

*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	-0.086	-	-	-	-0.010	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	0.020	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.049	0.000	-	-	0.005	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.096	-0.088	-	-0.096	-0.103	-0.106	-0.110	-	-0.149	-0.225	-0.233

§ 11/21 オファー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。
共通担保オペはノーオペを予想する。

11/21 の予定(国内)

10:30 政井日銀審議委員挨拶(埼玉)

11/21 の予定(海外)

米 シカゴ連銀全米活動指数(10月)
欧 ECB総裁講演(欧州議会)

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出合いレンジ予想								
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
◎	ノーオペ	▲34,200	3,118,900	+3,118,900	-0.070	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-0.070	-0.070
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				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				
2016/11/21 ~ 2016/12/5	8,000	1,510	1,510	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				
2016/11/14 ~ 2016/11/28	8,000	1,901	1,901	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				
2016/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	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				
2016/10/31 ~ 2016/11/14	8,000	2,660	2,660	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				
2016/10/24 ~ 2016/11/7	8,000	1,800	1,800	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/10/17 ~ 2016/10/31	8,000	1,861	1,861	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				
2016/10/11 ~ 2016/10/24	8,000	2,010	2,010	0.00%	固定金利	-	札割れ	11/17 ~ 11/25	担保範囲内	1	1	0.910%	固定金利	-	1.00				
2016/10/7 ~ 2017/1/16	5,000	210	210	0.00%	固定金利	-	札割れ	11/10 ~ 11/17	担保範囲内	1	1	0.910%	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