

# DAILY SIGNAL

平成28年11月21日(月)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 11/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは236兆2,000億円だった。  
無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出会いからスタート。  
その後は▲0.07～▲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、▲0.075%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	-	-	2,362,000	+2,362,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/21 のオペ結果
	11/21(月)		11/22(火)		11/24(木)		11/25(金)		
券	▲800		▲1,300		▲1,000		▲2,000		9:20
財政	▲34,700		▲200		+2,000		▲5,000		ノオベ
過不足	▲35,500		▲1,500		+1,000		▲7,000		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	国債買入(11/24-)
国債買入				+11,600		+4,800			(残存1年以下)
国庫短期証券買入				+15,000					+0.084%全取 700億
国債買現先									(残存5年超10年以下)
共通担保(本店)	▲1,400	+1,500							▲0.010%按分(15.8%) 4,105億
共通担保(全店)									11:50
CP買現先			▲200						国債補完供給(11/21-11/22)
CP等買入	▲500								▲0.500%全取 139億
社債等買入									12:50
ETF買入				+400					ノオベ
J-REIT買入									13:00
被災地金融機関支援									ノオベ
貸出									13:50
国債補完供給	+300	▲200	+200						国債補完供給(11/21-11/22)
米ドル供給用担保国債供給									▲0.500%全取 48億
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲35,800		+25,500		+5,800		▲6,000		
当座預金残高	3,117,300		3,142,800		3,148,600		3,142,600		
準備預金残高	2,812,400		2,354,600		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店)
積み終了先	2,353,900		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)
超過準備	304,900		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先
非準備先残高	99.0%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先
準備預金進捗率	20.0%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化
平均	79.0%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		被災地金融機関支援
乖離率	79.0%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		ロンハート残高
	2,111,300		20,500		900				0
今 積み期間の所要準備額(積数)	2,111,300		20,500		900				3,771
11/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数)	2,111,300		20,500		900				0
11/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均)	2,111,300		20,500		900				0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,111,300  
11/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 20,500  
11/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 900

	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
レボ	-	-0.115
レボ	-0.050	-
レボ	-	0.000
レボ	-	-0.090
出来値	-	-

(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%

11/18 のコール市場残高(前日比)		
合計	95,888	+6,628
有担	18,747	-730
無担	77,141	+7,358

\*出所: 営業毎旬報告  
\*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

11/18 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,167,000**

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.085	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.010	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.051	0.010	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.097	-0.092	-	-0.100	-0.103	-0.107	-0.111	-	-0.149	-0.225	-0.233

## § 11/22 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.086～+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。

## 11/22 の予定(国内)

9:00 9月の毎月勤労統計確報(厚労省)  
10:00 11月20日現在の営業毎旬報告(日銀)  
14:30 10月の全国百貨店売上高(百貨店協会)

## 11/22 の予定(海外)

米 9月の中古住宅販売件数(22日)  
11月1～2日のFOMC議事録(23日)  
10月新築住宅販売件数(23日)

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	+25,500	3,142,800	+3,142,800	-0.086	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/11/21 ~ 2016/12/5	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/11/14 ~ 2016/11/28	8,000	1,901	1,901	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/10/31 ~ 2016/11/14	8,000	2,660	2,660	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/10/24 ~ 2016/11/7	8,000	1,800	1,800	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/10/17 ~ 2016/10/31	8,000	1,861	1,861	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/10/11 ~ 2016/10/24	8,000	2,010	2,010	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/10/7 ~ 2017/1/16	5,000	210	210	0.00%	固定金利	- 札割れ

## 共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/10/20 ~ 2016/10/21	1,000	22	22	0.00%	0.000%	- 札割れ
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	- 札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%

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