

DAILY SIGNAL

平成28年11月24日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/24 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは238兆4,000億円だった。
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▲0.08～▲0.035%のレンジで取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、そのまま引けた。
また一部で試し取りの動きが見られ、+0.01%での出会いが見られた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,384,000	+2,384,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/24 のオペ結果
	11/24(木)		11/25(金)		11/28(月)		11/29(火)		
券	▲1,600		▲900		+0		▲1,000		9:20
財政	+1,400		▲900		▲6,000		▲5,000		ノーオペ
過不足	▲200		▲1,800		▲6,000		▲6,000		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(11/28-)
国債買入		+4,900				+12,300			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									+0.003%按分(98.3%) 4,004億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)					▲2,100	+3,000			+0.006%按分(97.6%) 4,207億
共通担保(全店)									(残存5年超10年以下)
CP買現先									+0.010%按分(45.3%) 4,111億
CP等買入	▲200		▲500	+1,000					11:50
社債等買入			▲200	+300					国債補完供給(11/24-11/25)
ETF買入									▲0.600% 全取 51億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+200	▲100	+100						共通担保(全店)(固定金利)
米ドル供給用担保国債供給									(11/28-12/12)
成長基盤強化支援									0%(全取) 2,851億円
貸出増加支援									(11/28-3/6)
									0%(全取) 100億円
当座預金増減	+4,600		▲1,100		+7,200		▲6,000		13:50
当座預金残高	3,147,000		3,145,900		3,153,100		3,147,100		国債補完供給(11/24-11/25)
準備預金残高	2,833,500		2,833,700		2,833,700		2,833,700		▲0.600% 全取 15億
積み終了先	2,383,700		2,383,700		2,383,700		2,383,700		共通担保(本店)
超過準備	2,383,700		2,383,700		2,383,700		2,383,700		共通担保(全店)
非準備先残高	313,500		313,500		313,500		313,500		国債買現先
準備預金進捗率	99.4%		99.4%		99.4%		99.4%		CP買現先
平均	30.0%		30.0%		30.0%		30.0%		成長基盤強化
乖離率	69.4%		69.4%		69.4%		69.4%		被災地金融機関支援
									ロンハート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,111,300
11/25 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 13,400
11/25 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 600

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.020	-
レボ	-	-0.100
レボ	-	-0.095
レボ	-0.050	-
レボ	-	0.000
レボ	-	-0.085
出来値	-	-

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	11/20
長期国債	202	282	354
CP等	2.2	2.2	2.4
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	10.6
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	469
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	469

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
11/24	648(3M)	-0.2754%	-0.2873%
11/17	647(3M)	-0.2716%	-0.2891%
11/16	646(1Y)	-0.2500%	-0.2749%

11/22 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	82,370	-142	-
有担	19,696	+583	-
無担	62,674	-725	-

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

11/22 時点のマナターベース(単位:億円) 4,158,600

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.080	-	-	-0.030	-0.025	-0.028	-	-	-	-	-
最高	0.020	-	-	0.003	-0.020	0.000	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-	-	-0.020	-0.021	-0.019	-	-0.020	-	-	-
東京レボレート	-0.096	-0.093	-	-0.103	-0.105	-0.108	-0.114	-	-0.149	-0.225	-0.233

§ 11/25 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。
共通担保オペはノーオペ予想。

11/25 の予定(国内)

11月の月例経済報告(内閣府)
8:30 CPI(全国9月、東京都区部10月中旬)(総務省)
14:00 10月の基調的なインフレ率を補正するための指標速報(日銀)

11/25 の予定(海外)

米 10月の財(モ)の貿易収支
株式・債券市場は短縮取引

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	
◎	ノーオペ	▲1,100	3,145,900	+3,145,900	-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)				*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
2016/11/28 ~ 2017/3/6	5,000	100	100	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
2016/11/28 ~ 2016/12/12	8,000	2,851	2,851	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
2016/11/21 ~ 2016/12/5	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
2016/11/14 ~ 2016/11/28	8,000	1,901	1,901	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
2016/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/10/31 ~ 2016/11/14	8,000	2,660	2,660	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
2016/10/24 ~ 2016/11/7	8,000	1,800	1,800	0.00%	固定金利	-	札割れ	11/25 ~ 12/1	担保範囲内	0	0	0.910%	固定金利	-	応札なし
2016/10/17 ~ 2016/10/31	8,000	1,861	1,861	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

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