

DAILY SIGNAL

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

§ 11/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは239兆3,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出合いからスタートし、
一部▲0.035%まで出合いが見られた。その後は▲0.08～▲0.04%のレンジで
推移した。後場に入っても調達需要は限定的で、▲0.08%台の出合いも見られ、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	-	-	2,393,000	+2,393,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/28 のオペ結果
	11/28(月)		11/29(火)		11/30(水)		12/1(木)		
券	▲500		▲1,300		+0		+0		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(11/30-) (残存5年超10年以下) ▲0.027%按分(29.5%) 4,106億 (残存10年超25年以下) ▲0.027%按分(69.2%) 1,903億 (残存25年超) ▲0.049%按分(80.3%) 1,100億 (物価連動債) ▲0.210円按分(86.6%) 251億 11:50 国債補充供給(11/28-11/29) ▲0.600% 全取 107億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補充供給(11/28-11/29) ▲0.600% 全取 687億
財政	▲7,800		+0		+14,000		▲10,000		
過不足	▲8,300		▲1,300		+14,000		▲10,000		
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		+12,400				+7,400			
国庫短期証券買入				+10,000					
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲2,100	+3,000							
CP買現先									
CP等買入	▲200		▲500			+3,500			
社債等買入									
ETF買入		+100							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補充供給	+100	▲800	+800						
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	+4,200		+9,000		+24,900		▲10,000		
当座預金残高	3,149,000		3,158,000		3,182,900		3,172,900		
準備預金残高	2,833,500		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
積み終了先	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
超過準備	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
非準備先残高	315,500		315,500		315,500		315,500		
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		
平均	43.3%		43.3%		43.3%		43.3%		
乖離率	56.2%		56.2%		56.2%		56.2%		
当座預金増減	+4,200		+9,000		+24,900		▲10,000		
準備預金残高	3,149,000		3,158,000		3,182,900		3,172,900		
積み終了先	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
超過準備	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
非準備先残高	315,500		315,500		315,500		315,500		
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		
平均	43.3%		43.3%		43.3%		43.3%		
乖離率	56.2%		56.2%		56.2%		56.2%		
当座預金増減	+4,200		+9,000		+24,900		▲10,000		
準備預金残高	3,149,000		3,158,000		3,182,900		3,172,900		
積み終了先	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
超過準備	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
非準備先残高	315,500		315,500		315,500		315,500		
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		
平均	43.3%		43.3%		43.3%		43.3%		
乖離率	56.2%		56.2%		56.2%		56.2%		
当座預金増減	+4,200		+9,000		+24,900		▲10,000		
準備預金残高	3,149,000		3,158,000		3,182,900		3,172,900		
積み終了先	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
超過準備	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
非準備先残高	315,500		315,500		315,500		315,500		
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		
平均	43.3%		43.3%		43.3%		43.3%		
乖離率	56.2%		56.2%		56.2%		56.2%		
当座預金増減	+4,200		+9,000		+24,900		▲10,000		
準備預金残高	3,149,000		3,158,000		3,182,900		3,172,900		
積み終了先	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
超過準備	2,833,300		2,833,300		2,833,300		2,833,300		
非準備先残高	315,500		315,500		315,500		315,500		
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		99.6%		99.6%		
平均	43.3%		43.3%		43.3%		43.3%		
乖離率	56.2%		56.2%		56.2%		56.2%		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,111,300
11/29 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 9,100
11/29 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 500

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.000	-0.100
レボG.C	-0.130	-0.130
ビッド	-0.050	0.000
レボG.C	-0.100	-0.100
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%

11/25 のコール市場残高(前日比)		
合計	86,572	+2,573
有担	19,433	+360
無担	67,139	+2,213

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

11/25 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,163,300

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	-0.005	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	0.000	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-0.003	-	-0.005	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.096	-0.093	-	-0.107	-0.108	-0.111	-0.116	-	-0.150	-0.225	-0.228

§ 11/29 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予想。

11/29 の予定(国内)

8:30 10月の有効求人倍率(厚労省)
10月の完全失業率(総務省)
10月の家計調査(総務省)

11/29 の予定(海外)

米 7～9月のGDP2次速報
NY連銀総裁の講演
パウエルFRB理事の講演

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	当増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノオベ	+9,000	3,158,000	+3,158,000	-0.086	-0.030	-0.030	-0.030	-0.030	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/11/28 ~ 2017/3/6	5,000	100	100	0.00%	固定金利	- 札割れ
2016/11/28 ~ 2016/12/12	8,000	2,851	2,851	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

*当日物

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%

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
11/25 ~ 12/1	担保範囲内	0	0	0.910%	固定金利	- 応札なし
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