

DAILY SIGNAL

平成28年11月30日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは240兆1,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.04%の出会いからスタートし、
その後は▲0.085～▲0.03%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	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,401,000	+2,401,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				11/30 のオペ結果
	11/30(水)		12/1(木)		12/2(金)		12/5(月)		
券	▲1,100		▲1,700		▲1,000		▲1,000		9:20
財政	+12,500		▲9,000		▲65,000		▲4,000		ノーオペ
過不足	+11,400		▲10,700		▲66,000		▲5,000		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(12/2-)
国債買入		+8,000				+11,200			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									▲0.003%按分(43.8%) 4,008億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									+0.005%按分(87.0%) 4,204億
共通担保(全店)									(残存10年超25年以下)
CP買現先									+0.009%按分(69.8%) 1,903億
CP等買入	▲1,800	+3,500	▲200				▲1,500		(残存25年超)
社債等買入									▲0.003%按分(7.3%) 1,111億
ETF買入									11:50
J-REIT買入									国債補完供給(11/30-12/1)
被災地金融機関支援									▲0.600% 全取 68億
貸出									12:50
国債補完供給	+100	▲100	+100						ノーオペ
米ドル供給用担保国債供給									13:00
成長基盤強化支援					▲1,600	+6,200	▲100	+0	ノーオペ
貸出増加支援									
当座預金増減	+21,100		▲10,800		▲50,200		▲6,600		
当座預金残高	3,177,000		3,166,200		3,116,000		3,109,400		
準備預金残高	2,838,800								共通担保(本店)
積み終了先	2,394,000		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +8,000		共通担保(全店)
超過準備	2,393,800								0
非準備先残高	338,200								0
準備預金進捗率	99.6%								0
平均	50.0%		予想込増減 ▲10,800		予想込増減 ▲50,200		予想込増減 +1,400		成長基盤強化
乖離率	49.6%		当預見込 3,166,200		当預見込 3,116,000		当預見込 3,117,400		71,647
									被災地金融機関支援
									5,052
									ロンバート残高
									0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,110,900
12/1 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 7,400
12/1 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		
オフア	0.000	-
レボ	-	-0.100
レボ	-	-0.105
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	11/20
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%

11/29 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	89,229	+7,167	
有担	19,497	+37	
無担	69,732	+7,130	

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

11/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,176,200

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	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-	-	-0.021	-0.010	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.105	-0.098	-	-0.105	-0.107	-0.111	-0.152	-	-0.149	-0.225	-0.228

§ 12/1 オフア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。
共通担保オペは期落ち分がロールオフアされよう。

12/1 の予定(国内)

桜井日銀審議委員が金融経済懇話会に出席・会見
8:50 前週の対外対内証券売買契約等の状況(財務省)
16:00 11月調査の債券市場サーベイ(日銀)

12/1 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
11月製造業PMI確報
ダウ連銀総裁の講演

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	▲10,800	3,166,200	+3,166,200	-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)					*当日物					共通担保資金供給(本店)					*当日物				
期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	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	オフア額	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	12/1 ~ 12/8	担保範囲内	0	0	0.890%	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	11/25 ~ 12/1	担保範囲内	0	0	0.910%	固定金利	-	応札なし				

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