

DAILY SIGNAL

平成28年12月1日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/1 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは239兆6,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.035%の出会いからスタートし、
その後は▲0.08～▲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、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,396,000	+2,396,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/1 のオペ結果
	12/1(木)		12/2(金)		12/5(月)		12/6(火)		
券	▲1,800		▲1,700		▲1,000		▲1,000		9:20
財政	▲9,100		▲72,400		▲4,000		▲4,000		ノオベ
過不足	▲10,900		▲74,100		▲5,000		+2,000		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	ノオベ
国債買入				+11,800					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(12/1-12/2)
国債買現先									▲0.600% 全取 18億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲1,500	+1,500			ノオベ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲200						共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入			▲200						(12/5-12/19)
ETF買入									0% 全取 1,510億
J-REIT買入									13:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(12/1-12/2)
貸出									▲0.600% 全取 6億
国債補完供給	+100								
米ドル供給用担保国債供給			▲5,200	+6,200	▲100	+0			
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲11,000		▲61,700		▲5,100		+2,000		
当座預金残高	3,166,000		3,104,300		3,099,200		3,101,200		
準備預金残高	2,843,600								共通担保(本店)
積み終了先	2,399,300								共通担保(全店)
超過準備	2,399,300								国債買現先
非準備先残高	322,400								CP買現先
準備預金進捗率	99.7%								成長基盤強化
平均	53.3%		予想込増減 ▲61,700		予想込増減 ▲5,100		予想込増減 +2,000		被災地金融機関支援
乖離率	46.4%		当預見込 3,104,300		当預見込 3,099,200		当預見込 3,101,200		ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,110,900
12/2 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 6,600
12/2 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	-	-0.100
ビッド	-	0.000
レボG.C	-	-0.090
出来値	-	-

11/30 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,198,400

(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	回数	最高利回	平均利回
12/1	649(3M)	-0.3330%	-0.3408%
11/24	648(3M)	-0.2754%	-0.2873%
11/17	647(3M)	-0.2716%	-0.2891%

11/30 のコール市場残高(前日比)			
合計	75,346	-	-13,883
有担	19,918	-	+421
無担	55,428	-	-14,304

*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	-0.085	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.051	-	-	-0.025	-0.025	0.001	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.102	-0.095	-	-0.106	-0.107	-0.112	-0.154	-	-0.147	-0.225	-0.228

§ 12/2 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.085～+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。

12/2 の予定(国内)

8:50 11月のマネタリーベース(日銀)
10:00 11月30日現在の営業毎旬報告(日銀)

12/2 の予定(海外)

米 11月の雇用統計
ブレイドFRB理事の講演
ル-DFRB理事の講演

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	
◎	ノオベ	▲61,700	3,104,300	+3,104,300	-0.085	-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	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
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

*当日物

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%

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
12/1 ~ 12/8		0	0	0.890%	固定金利	- 応札なし
11/25 ~ 12/1		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