

DAILY SIGNAL

平成28年12月6日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/6 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは236兆6,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.035%の出合から始まり、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	-	-	2,366,000	+2,366,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/6 のオペ結果
	12/6(火)		12/7(水)		12/8(木)		12/9(金)		
券	▲1,400		▲1,300		▲3,000		▲3,000		9:20
財政	+1,000		+3,600		▲4,000		+1,000		ノオベ
過不足	▲400		+2,300		▲7,000		▲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		+12,500		+4,100					10:40
国庫短期証券買入		+5,000							米ドル資金供給(12/8-12/15)
国債買現先									貸付利率0.890% 11百万米ドル
共通担保(本店)									CP等買入(12/9-)
共通担保(全店)									▲0.004%按分(23.6%) 4,497億
CP買現先	▲400		▲100						11:50
CP等買入							+4,500		国債補完供給(12/6-12/7)
社債等買入									▲0.600% 全取 120億
ETF買入									12:50
J-REIT買入									ノオベ
被災地金融機関支援									13:00
貸出									ノオベ
国債補完供給	+1,100	▲500	+500						13:50
米ドル供給用担保国債供給									国債補完供給(12/6-12/7)
成長基盤強化支援									▲0.600% 全取 377億
貸出増加支援									14:45
当座預金増減	+17,300		+6,800		▲7,000		+2,500		米ドル資金供給用担保国債
当座預金残高	3,115,700		3,122,500		3,115,500		3,118,000		供給(売現先)(12/7-12/16)
準備預金残高	2,806,400		2,367,700		ノオベ		ノオベ		▲0.100% 全取 13億
積み終了先	2,367,700		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(本店)
超過準備	2,367,700		ノオベ		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店)
非準備先残高	309,300		ノオベ		ノオベ		ノオベ		国債買現先
準備預金進捗率	99.9%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		CP買現先
平均	70.0%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		成長基盤強化
乖離率	29.9%		ノオベ		ノオベ		ノオベ		被災地金融機関支援
			予想込増減	+6,800	予想込増減	▲7,000	予想込増減	+2,500	ローンハート残高
			当預見込	3,122,500	当預見込	3,115,500	当預見込	3,118,000	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,110,900
12/7 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 3,000
12/7 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 300

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.000	-
レボ	-	-0.100
レボ	-	-0.100
レボ	-	0.000
レボ	-	-0.090
出来値	-	-

12/5 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,123,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	11/30
長期国債	202	282	357
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	3.8	6.9	10.7
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	53
その他とも資産計	300	383	471
銀行券	93	98	97
当座預金	178	253	318
その他とも負債・純資産計	300	383	471

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	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%

12/5 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	85,769	-669	
有担	21,585	+852	
無担	64,184	-1,521	

*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	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.010	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.054	-	-	0.003	-0.033	-0.020	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.098	-0.092	-	-0.101	-0.103	-0.109	-0.148	-	-0.148	-0.225	-0.228

§ 12/7 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。

12/7 の予定(国内)

8:50 11月のマネタリーベースと日本銀行の取引(日銀)
10:30 岩田日銀副総裁の挨拶(長崎)
14:00 10月の景気動向指数速報(内閣府)

12/7 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数

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	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y	
◎	ノオベ	+6,800	3,122,500	+3,122,500	-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
12/8 ~ 12/15	担保範囲内	11	11	0.890%	固定金利	- 1.00
12/1 ~ 12/8	担保範囲内	0	0	0.890%	固定金利	- 応れなし

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