

DAILY SIGNAL

平成28年12月7日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/7 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは236兆5,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.03%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。
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	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,365,000	+2,365,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/7 のオペ結果
	12/7(水)		12/8(木)		12/9(金)		12/12(月)		
券	▲1,200		▲2,400		▲3,000		▲1,000		9:20 ノオベ 10:10 国債買入(12/9-) (残存1年超3年以下) ▲0.004%按分(83.1%) 4,002億 (残存3年超5年以下) ▲0.003%按分(37.0%) 4,206億 (残存5年超10年以下) ▲0.007%按分(58.6%) 4,110億 (物価連動債) ▲0.310円按分(78.6%) 250億 11:50 国債補完供給(12/7-12/8) ▲0.600% 全取 29億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政	+300		▲1,100		+1,000		▲22,000		
過不足	▲900		▲3,500		▲2,000		▲23,000		
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		+4,100				+12,600			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲2,900		
CP買現先									
CP等買入	▲100		▲200						
社債等買入									
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給		+500							
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									
貸出増加支援									
当座預金増減	+3,600		▲3,700		+15,100		▲25,900		
当座預金残高	3,119,300		3,115,600		3,130,700		3,104,800		
準備預金残高	2,799,800								
積み終了先	2,363,000		ノオベ		ノオベ		共通担保(全店) +8,000		
超過準備	2,363,000								
非準備先残高	319,500								
準備預金進捗率	99.9%								
平均	73.3%		予想込増減 ▲3,700		予想込増減 +15,100		予想込増減 ▲17,900		
乖離率	26.5%		当預見込 3,115,600		当預見込 3,130,700		当預見込 3,112,800		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,122,300
12/8以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,500
12/8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	-	-0.100	-0.095
ビッド	-	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

12/6 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,142,500

(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
12/7	650(3M)	-0.3523%	-0.3603%
12/1	649(3M)	-0.3330%	-0.3408%
11/24	648(3M)	-0.2754%	-0.2873%

12/6 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	84,815	21,085	63,730
	-954	-500	-454

*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	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.056	-	-	-0.024	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.097	-0.092	-	-0.098	-0.102	-0.109	-0.149	-	-0.150	-0.225	-0.228

§ 12/8 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。
共通担保オペは期落ち分がロールオファーされよう。

12/8 の予定(国内)

黒田日銀総裁の挨拶(年末エコノミスト懇親会)
8:50 7～9月のGDP・2次速報(内閣府)
14:00 11月の景気ウッチャー調査(内閣府)

12/8 の予定(海外)

米 週間新規失業保険申請件数
ユーロ圏 ECB理事会、ECB総裁の会見

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	▲3,700	3,115,600	+3,115,600	-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

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

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% 1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0% 2.70
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