

DAILY SIGNAL

平成28年12月8日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは236兆9,000億円だった。
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▲0.085～▲0.03%のレンジで取引された。
調達一巡後はヒッドが薄くなり、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	-	-	2,369,000	+2,369,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/8 のオペ結果
	12/8(木)		12/9(金)		12/12(月)		12/13(火)		
券	▲2,400		▲2,200		▲1,000		▲1,000		9:20
財政	▲2,600		▲2,900		▲22,000		+1,000		ノーオペ
過不足	▲5,000		▲5,100		▲23,000		+0		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	ノーオペ
国債買入				+12,800					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(12/8-12/9)
国債買現先									▲0.600% 全取 264億
共通担保(本店)									12:50
共通担保(全店)					▲2,900	+2,000			ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲200		▲500	+4,500					共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入			▲200						(12/12-12/26)
ETF買入				+700					0% 全取 1,950億
J-REIT買入									13:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(12/8-12/9)
貸出									▲0.600% 全取 30億
国債補完供給		▲300		+300					
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	▲5,500		+12,500		▲23,900		+0		
当座預金残高	3,113,800		3,126,300		3,102,400		3,102,400		
準備預金残高	2,801,600								共通担保(本店)
積み終了先	2,366,500								共通担保(全店)
超過準備	2,366,500								国債買現先
非準備先残高	312,200								CP買現先
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化
平均	76.7%		予想込増減 +12,500		予想込増減 ▲23,900		予想込増減 +0		被災地金融機関支援
乖離率	23.2%		当預見込 3,126,300		当預見込 3,102,400		当預見込 3,102,400		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,122,300
12/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,000
12/9 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
ヒッド	-	-0.095
出来値	-	0.000
	-	-0.085

12/7 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,147,300

(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
12/8	651(3M)	-0.3903%	-0.4032%
12/7	650(6M)	-0.3523%	-0.3603%
12/1	649(3M)	-0.3330%	-0.3408%

12/7 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	84,688	21,659	-127
		+574	
	63,029		-701

*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	-0.086	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.053	-	-	-0.028	-0.031	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.098	-0.092	-	-0.099	-0.102	-0.146	-0.149	-	-0.150	-0.225	-0.228

§ 12/9 オファタ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。
共通担保オペはノーオペを予想する。

12/9 の予定(国内)

8:50 11月のマネーストック(日銀)
当座預金のマロ加算残高基準比率の公表(日銀)

12/9 の予定(海外)

米 12月のミシガン消費者信頼感速報

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	+12,500	3,126,300	+3,126,300	-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)				*当日物				共通担保資金供給(本店)				*当日物			
期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/12/12 ~ 2016/12/26	8,000	1,950	1,950	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
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	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
2016/11/28 ~ 2017/3/6	5,000	100	100	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
2016/11/28 ~ 2016/12/12	8,000	2,851	2,851	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
2016/11/21 ~ 2016/12/5	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/11/14 ~ 2016/11/28	8,000	1,901	1,901	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2016/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	0.00%	固定金利	-	札割れ	12/8 ~ 12/15	担保範囲内	11	11	0.890%	固定金利	-	1.00
2016/10/31 ~ 2016/11/14	8,000	2,660	2,660	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