

DAILY SIGNAL

平成28年12月12日(月)

上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/12 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは235兆6,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.03%の出合いからスタートし、
その後は▲0.08～▲0.02%のレンジで取引された。
後場においては、調整程度の出合いが見られて引けた。
ターム物では試し取りの動きがあり、年内物でマイナス圏の出合いが見られた。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,356,000	+2,356,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/12 のオペ結果
	12/12(月)		12/13(火)		12/14(水)		12/15(木)		
券	▲900		▲2,500		▲2,000		▲3,000		9:20
財政	▲29,000		+1,500		+26,000		+59,000		ノーオペ
過不足	▲29,900		▲1,000		+24,000		+56,000		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	ノーオペ
国債買入				+11,300					11:50
国庫短期証券買入				+12,500					国債補完供給(12/12-12/13)
国債買現先									▲0.600% 全取 193億
共通担保(本店)	▲2,900	+2,000							12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先			▲900						13:00
CP等買入	▲400								ノーオペ
社債等買入				+100					
ETF買入		+300							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									
国債補完供給	+100	▲200	+200						
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							▲9,600		
当座預金増減	▲31,000		+22,200		+24,000		+46,400		
当座預金残高	3,094,500		3,116,700		3,140,700		3,187,100		
準備預金残高	2,795,100								共通担保(本店)
積み終了先	2,355,900								共通担保(全店)
超過準備	2,355,600								国債買現先
非準備先残高	299,400								CP買現先
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化
平均	90.0%		予想込増減 +22,200		予想込増減 +24,000		予想込増減 +46,400		被災地金融機関支援
乖離率	9.9%		当預見込 3,116,700		当預見込 3,140,700		当預見込 3,187,100		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,122,300
12/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 200
12/13 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	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
ビッド	-0.050	0.000
出来値	-	-

12/9 時点のマナターベース(単位:億円) 4,158,100

(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%

12/9 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	89,851	+7,395	+276
	22,185	-	+7,119
	67,666	-	-

*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	-0.083	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.052	0.000	-	-0.010	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.097	-0.092	-	-0.100	-0.104	-0.161	-0.152	-	-0.149	-0.225	-0.228

§ 12/13 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。

12/13 の予定(国内)

8:50 日銀マナターサーベイ(10月)
10:00 日銀営業毎準報告(12月10日現在)

12/13 の予定(海外)

米 FOMC(14日まで)
輸入物価指数(11月)

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
◎	ノーオペ	+22,200	3,116,700	+3,116,700	-0.085	-0.030	-0.030	-0.010	-0.010	-0.010	-0.020	-0.030
					~	~	~	~	~	~	~	~
					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	按分レート	平均レート	倍率
2016/12/12 ~ 2016/12/26	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

*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	按分レート	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	按分レート	平均レート	倍率
12/8 ~ 12/15		11	11	0.890%	固定金利	- 1.00
12/1 ~ 12/8		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