

DAILY SIGNAL

平成28年12月19日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/19 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは247兆1,000億円だった。
無担保コールON物は、朝方▲0.03%の出会いから始まった。
その後もビッドは厚く▲0.05～▲0.025%のレンジで取引された。
後場に入っても堅調な地合いは変わらず、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	-	-	2,471,000	+2,471,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/19 のオペ結果
	12/19(月)		12/20(火)		12/21(水)		12/22(木)		
券	▲2,700		▲4,700		▲5,000		▲5,000		9:20
財政	▲2,900		+62,800		+2,000		▲1,000		ノーオペ
過不足	▲5,600		+58,100		▲3,000		▲6,000		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	国庫短期証券買入(12/21-)
国債買入				+4,200		+12,300			▲0.008%按分(84.0%) 12,500億
国庫短期証券買入						+12,500			国債買入(12/21-)
国債買現先									(残存1年超3年以下)
共通担保(本店)	▲1,500	+1,600							▲0.012%按分(98.1%) 4,002億
共通担保(全店)			▲500						(残存3年超5年以下)
CP買現先			▲1,300						▲0.016%按分(20.0%) 4,202億
CP等買入	▲300								(残存5年超10年以下)
社債等買入				+100					▲0.009%按分(19.6%) 4,105億
ETF買入								+1,300	11:50
J-REIT買入									国債補充供給(12/19-12/20)
被災地金融機関支援								+100	▲0.500% 全取 111億
貸出									12:50
国債補充供給	+200	▲100	+100						ノーオペ
米ドル供給用担保国債供給									13:00
成長基盤強化支援									ノーオペ
貸出増加支援									
当座預金増減	▲5,700		+60,700		+21,800		▲4,600		
当座預金残高	3,254,200		3,314,900		3,336,700		3,332,100		
準備預金残高	2,930,000								
積み終了先	2,460,100								共通担保(本店)
超過準備	2,443,900								共通担保(全店)
非準備先残高	324,200								国債買現先
準備預金進捗率	98.0%								CP買現先
平均	12.9%		予想込増減 +60,700		予想込増減 +21,800		予想込増減 ▲4,600		成長基盤強化
乖離率	85.1%		当預見込 3,314,900		当預見込 3,336,700		当預見込 3,332,100		被災地金融機関支援
									ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,198,900
12/20 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 43,900
12/20 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 1,600

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.025	-
レボ	-	-0.100
CP	-0.050	-
レボ	-	-0.090
出来値	-	-

12/16 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,304,400

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	12/10
長期国債	202	282	362
CP等	2.2	2.2	2.6
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	10.8
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	476
銀行券	93	98	99
当座預金	178	253	313
その他とも負債・純資産計	300	383	476

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
12/16	653(1Y)	-0.3000%	-0.3388%
12/15	652(3M)	-0.3925%	-0.4196%
12/8	651(3M)	-0.3903%	-0.4032%

12/16 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	91,626	-126	
有担	20,298	+251	
無担	71,328	-377	

*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	-0.070	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.002	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.036	0.010	-	-0.015	-	-0.035	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.095	-0.089	-	-0.099	-0.176	-0.163	-0.155	-	-0.151	-0.225	-0.228

§ 12/20 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.07～+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。

12/20 の予定(国内)

日銀金融政策決定会合及び同結果の公表
黒田日銀総裁会見

12/20 の予定(海外)

特になし

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	+60,700	3,314,900	+3,314,900	-0.070	-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	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
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	札割れ
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

*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
12/15 ~ 12/22	担保範囲内	403	403	1.080%	固定金利	-
12/8 ~ 12/15	担保範囲内	11	11	0.890%	固定金利	-

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