

DAILY SIGNAL

平成28年12月20日(火)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/20 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは249兆6,000億円だった。無担保コールON物は、朝方▲0.035%の出合いから始まり、▲0.04~▲0.025%のレンジで取引された。前営業日より調達意欲は強まり、一部▲0.02%での出合いも見られた。後場においては、調整程度の出合いが見られて引けた。本日の日銀金融政策決定会合では金融政策の現状維持が決定された。

(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	-	-	2,496,000	+2,496,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/20 のオペ結果
	12/20(火)		12/21(水)		12/22(木)		12/26(月)		
券	▲4,800		▲4,600		▲5,000		▲2,000		9:20
財政	+62,500		▲3,400		▲1,000		▲10,000		ノーオペ
過不足	+57,700		▲8,000		▲6,000		▲12,000		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		+4,200		+12,400					10:40
国庫短期証券買入				+12,500					米ドル資金供給(12/22-12/30)
国債買現先									貸付利率1.160% 486百万米ドル
共通担保(本店)									11:50
共通担保(全店)							▲2,000		国債補完供給(12/20-12/21)
CP買現先			▲600						▲0.500% 全取 1,997億
CP等買入	▲500		▲100						12:50
社債等買入	▲1,300					+1,300			ノーオペ
ETF買入		+100		+100					13:00
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援					+0	+100			13:50
貸出									国債補完供給(12/20-12/21)
国債補完供給	+100	▲2,300	+2,300						▲0.500% 全取 140億
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	+58,000		+18,600		▲4,600		▲14,000		
当座預金残高	3,312,200		3,330,800		3,326,200		3,312,200		
準備預金残高	2,983,200		2,479,200		共通担保オペ当社予想		共通担保(全店) +8,000		共通担保(本店) 0
積み終了先			ノーオペ		ノーオペ				共通担保(全店) 3,860
超過準備	2,477,500								国債買現先 0
非準備先残高	329,000								CP買現先 0
準備預金進捗率	98.6%								成長基盤強化 76,205
平均	16.1%		予想込増減 +18,600		予想込増減 ▲4,600		予想込増減 ▲6,000		被災地金融機関支援 5,052
乖離率	82.5%		当預見込 3,330,800		当預見込 3,326,200		当預見込 3,320,200		ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,198,900

12/21 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 29,900

12/21 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,100

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.030	-	-0.100	-0.095
ビッド	-0.035	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

12/19 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,301,400

(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%

12/19 のコール市場残高(前日比)

	合計	92,326	+700
有担	17,947	-2,351	
無担	74,379	+3,051	

*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	-	-	-0.040	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.032	-0.010	-	-0.032	-0.035	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.096	-0.093	-	-0.100	-0.179	-0.167	-0.153	-	-0.151	-0.225	-0.228

§ 12/21 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。共通担保オペは期落ち分がロールオファーされよう。

12/21 の予定(国内)

13:30 10月の全産業活動指数(経産省)
未定 12月の月例経済報告(内閣府)

12/21 の予定(海外)

米 週間のMBA住宅ローン申請指数
11月の中古住宅販売件数
ユーロ圏 12月の消費者信頼感

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	+18,600	3,330,800	+3,330,800	-0.070	-0.040	-0.040	-0.040	-0.040	-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
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	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
2016/12/12 ~ 2016/12/28	8,000	1,950	1,950	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
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	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 ~ 2017/3/6	5,000	100	100	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
2016/11/28 ~ 2016/12/12	8,000	2,851	2,851	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/11/21 ~ 2016/12/5	8,000	1,510	1,510	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
2016/11/14 ~ 2016/11/28	8,000	1,901	1,901	0.00%	固定金利	-	札割れ	12/22 ~ 12/30	担保範囲内	486	486	1.160%	固定金利	-	1.00
2016/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	0.00%	固定金利	-	札割れ	12/15 ~ 12/22	担保範囲内	403	403	1.080%	固定金利	-	1.00

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