

DAILY SIGNAL

平成28年12月21日(水)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/21 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは250兆円だった。
無担保コールON物は朝方▲0.03%の出会いから始まった。
その後は▲0.025~▲0.03%の狭いレンジで出会いが見られた。
後場に入っても調達需要は底堅く、▲0.03~▲0.045%のレンジで取引が散見された。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,500,000	+2,500,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/21 のオペ結果
	12/21(水)		12/22(木)		12/26(月)		12/27(火)		
券	▲4,600		▲5,300		▲2,000		▲3,000		9:20
財政	▲3,100		+6,600		▲10,000		+2,000		ノオベ
過不足	▲7,700		+1,300		▲12,000		▲1,000		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	ノオベ
国債買入		+12,400							11:50
国庫短期証券買入		+12,500							国債補完供給(12/21-12/22)
国債買現先									▲0.500% 全取 255億
共通担保(本店)					▲2,000	+2,700			12:50
共通担保(全店)									ノオベ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲600		▲500	+1,300					共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入	▲100		▲100						(12/26-1/10)
ETF買入		+100							0% 全取 2,652億
J-REIT買入									
被災地金融機関支援				+100					
貸出									
国債補完供給	+2,300	▲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	+18,600		+2,400		▲11,300		▲1,000		
当座預金残高	3,330,800		3,333,200		3,321,900		3,320,900		
準備預金残高	2,986,800								共通担保(本店)
積み終了先	2,487,900								共通担保(全店)
超過準備	2,484,200								国債買現先
非準備先残高	344,000								CP買現先
準備預金進捗率	99.1%								成長基盤強化
平均	19.4%		予想込増減 +2,400		予想込増減 ▲11,300		予想込増減 ▲1,000		被災地金融機関支援
乖離率	79.8%		当預見込 3,333,200		当預見込 3,321,900		当預見込 3,320,900		ロンハート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,198,900
12/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 19,600
12/22 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 800

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

12/20 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,364,200

(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
12/19	654(3M)	-0.3952%	-0.4125%
12/16	653(1Y)	-0.3000%	-0.3388%
12/15	652(3M)	-0.3925%	-0.4196%

12/20 のコール市場残高(前日比)		
合計	100,639	+8,313
有担	19,449	+1,502
無担	81,190	+6,811

*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	-0.080	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.027	-	-	-0.027	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.095	-0.090	-	-0.226	-0.179	-0.167	-0.149	-	-0.150	-0.225	-0.228

§ 12/22 オフア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。
共通担保オペはノオベを予想する。

12/22 の予定(国内)

日本銀行が保有する国債の銘柄別残高(日銀) 米 7~9月GDP確報値
日本銀行による国庫短期証券の銘柄別買入額(日銀) 週間新規失業保険申請件数
10:00 12月20日現在の営業毎旬報告(日銀) ユーロ圏 ECB月報

12/22 の予定(海外)

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	+2,400	3,333,200	+3,333,200	-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)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	0.00%	固定金利	- 札割れ
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

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
12/22 ~ 12/30	担保範囲内	486	486	1.160%	固定金利	- 1.00
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