

DAILY SIGNAL

平成28年12月22日(木)

上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 12/22 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは249兆8,000億円だった。
 無担保コールON物は朝方▲0.02%の出合いから始まった。
 その後は▲0.02~▲0.045%のレンジで取引された。
 調達一巡後はビッドは薄くなり、▲0.05~▲0.07%のレンジで出合いが見えられた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残高見込	所要対比
8:00	-	-	2,498,000	+2,498,000

(単位:億円)

	日銀速報 12/22(木)		日銀予想 12/26(月)		当社需給予想 12/27(火)				12/28(水)				12/22のオペ結果
	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	エンド	スタート	エンド	スタート	
券		▲5,300		▲3,100		▲3,000		▲3,000		▲3,000		▲3,000	9:20 ノオベ 10:10 国庫短期証券買入(12/27-) ▲0.016%按分(75.7%) 7,500億 国債買入(12/27-) (残存5年超10年以下) ▲0.007%按分(8.7%) 4,108億 (物連動債) ▲0.070円按分(42.9%) 252億 11:50 国債補完供給(12/22-12/26) ▲0.500%全取 1,054億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ
財政		+5,600		▲14,900		+2,000		+2,000		+2,000		+2,000	
過不足		+300		▲18,000		▲1,000		▲5,000					
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	エンド	スタート	エンド	スタート	
国債買入													
国庫短期証券買入													
国債買現先													
共通担保(本店)			▲2,000	+2,700									
共通担保(全店)													
CP買現先													
CP等買入	▲500		▲700										
社債等買入	▲100	+1,300	▲200										
ETF買入				+100									
J-REIT買入													
被災地金融機関支援		+100											
貸出													
国債補完供給	+300	▲1,100	+1,100										
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		+300	▲17,000		+10,900		▲5,000						
当座預金残高		3,331,100	3,314,100		3,325,000		3,320,000						
準備預金残高		2,996,600											
積み終了先		2,501,200											
超過準備		2,499,000											
非準備先残高		334,500											
準備預金進捗率		99.6%											
平均		32.3%	予想込増減	▲17,000	予想込増減	+10,900	予想込増減	▲5,000					
乖離率		67.4%	当預見込	3,314,100	当預見込	3,325,000	当預見込	3,320,000					

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,198,900
 12/26 以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 7,700
 12/26 以降の残り積み立て額(残り所要)平均) 400

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

12/21 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,387,500

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	12/20
長期国債	202	282	359
CP等	2.2	2.2	2.7
社債等	3.2	3.2	3.1
ETF	3.8	6.9	10.9
J-REIT	0.18	0.27	0.35
貸出支援基金	25	31	41
国庫短期証券	49	43	48
その他とも資産計	300	383	473
銀行券	93	98	100
当座預金	178	253	331
その他とも負債・純資産計	300	383	473

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回数	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%

12/21のコール市場残高(前日比)

合計	有担	無担
103,451	18,601	84,850
+2,812	-848	+3,660

*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	-	-	-	-0.022	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-0.020	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.028	-	-	-	-0.022	-	0.005	-	-	-	-
東京レポレート	-0.094	-0.089	-	-0.246	-0.183	-0.168	-0.153	-	-0.150	-0.225	-0.228

§ 12/26 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。

12/26 の予定(国内)

黒田日銀総裁が経団連審議委員会で講演
 8:50 10月31日~11月1日の金融政策決定会合議事要旨(日銀)
 14:00 10月の景気動向指数改訂値(内閣府)

12/26 の予定(海外)

米・欧 クリスマスの振替で休日

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
◎ ノオベ	▲17,000	3,314,100	+3,314,100	-0.080	-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

共通担保資金供給(全店)					*当日物		
期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	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

共通担保資金供給(本店)					*当日物		
期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	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