

DAILY SIGNAL

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

§ 12/28 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは250兆3,000億円だった。
無担保コールON物は▲0.035%の合出から始まり、その後は▲0.06～▲0.035%のレンジで取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、後場に入って▲0.065%近辺で調整程度の出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,503,000	+2,503,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/28 のオペ結果
	12/28(水)		12/29(木)		12/30(金)		1/4(水)		
券	▲2,600		▲2,300		▲1,000		+6,000		9:20 ノオベ 10:10 (残存10年超25年以下) (残存25年超) +0.006%按分(48.3%) 1,905億 +0.010%按分(59.6%) 1,103億 (変動利付債) ▲0.120円按分(89.9%) 1,001億 10:40 米ドル資金供給(12/30-1/6) 貸付利率1.060% 1,223百万米ドル 11:50 国債補充供給(12/28-12/29) ▲0.500% 全取 1,290億 12:50 ノオベ 13:00 ノオベ 13:50 国債補充供給(12/28-12/29) ▲0.500% 全取 5億
財政	+800		▲11,400		+0		+0		
過不足	▲1,800		▲13,700		▲1,000		+6,000		
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	
国債買入						+4,000			
国庫短期証券買入									
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)							▲1,600		
CP買現先									
CP等買入	▲1,600		▲500			+4,500			
社債等買入									
ETF買入		+800							
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補充供給	+300	▲1,400	+1,400						
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	▲3,700		▲12,800		+7,500		+4,400		
当座預金残高	3,322,800		3,310,000		3,317,500		3,321,900		
準備預金残高	2,995,800								
積み終了先	2,505,700								
超過準備	2,505,700								
非準備先残高	327,000								
準備預金進捗率	99.7%								
平均	41.9%		予想込増減 ▲12,800		予想込増減 +7,500		予想込増減 +12,400		
乖離率	57.8%		当預見込 3,310,000		当預見込 3,317,500		当預見込 3,329,900		

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,198,800
12/29 以降の残り積み立て額(残り所要)積数 5,500
12/29 以降の残り積み立て額(残り所要)平均 300

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	-0.030	-
レボ	-	-0.100
レボ	-	-0.400
レボ	-	-0.300
レボ	-	-

(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%

12/27 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
合計	102,313	+8,509	
有担	20,987	+2,251	
無担	81,326	+6,258	

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

12/27 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,393,900**

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	-0.070	-	-	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.030	-	-	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.046	-0.058	-	-	-	-	-	-0.015	-	-	-
東京レボレート	-0.091	-0.088	-	-0.299	-0.199	-0.167	-0.150	-	-0.150	-0.225	-0.228

§ 12/29 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.08～+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。

12/29 の予定(国内)

8:50 12月の金融政策決定会合における
主な意見(日銀)

12/29 の予定(海外)

米 週間の新規失業保険申請件数

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	▲12,800	3,310,000	+3,310,000	-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				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
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	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
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	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
2016/12/12 ~ 2016/12/26	8,000	1,950	1,950	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
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	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 ~ 2017/3/6	5,000	100	100	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ							
2016/11/28 ~ 2016/12/12	8,000	2,851	2,851	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
2016/11/21 ~ 2016/12/5	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	-	札割れ	12/30 ~ 1/6	担保範囲内	1,223	1,223	1.060%	固定金利	-	1.00
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

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