

DAILY SIGNAL

平成28年12月29日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/29 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▲0.04%の出合から始まり、その後は▲0.06~▲0.035%のレンジで取引される展開となった。調達一巡後はビット水準が低下し、後場に入って▲0.065%近辺での出合が散見されて引けた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,496,000	+2,496,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/29 のオペ結果
	12/29(木)		12/30(金)		1/4(水)		1/5(木)		
券	▲2,200		▲100		+6,000		+6,000		9:20
財政	▲11,700		▲6,700		+0		▲2,000		ノーオペ
過不足	▲13,900		▲6,800		+6,000		+4,000		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	国債買入(1/4-)
国債買入				+4,100		+12,300			(残存1年超3年以下)
国庫短期証券買入									▲0.007%按分(62.1%) 4,004億
国債買現先									(残存3年超5年以下)
共通担保(本店)									▲0.010%按分(86.1%) 4,204億
共通担保(全店)					▲1,600	+1,300			(残存5年超10年以下)
CP買現先									▲0.010%按分(26.3%) 4,106億
CP等買入	▲500		▲3,800	+4,500					11:50
社債等買入				+700					国債補完供給(12/29-12/30)
ETF買入									▲0.500% 全取 164億
J-REIT買入									12:50
被災地金融機関支援									ノーオペ
貸出									13:00
国債補完供給	+1,400	▲200	+200						共通担保(全店)(固定金利)
米ドル供給用担保国債供給									(1/4-1/16)
成長基盤強化支援									0% 全取 1,300億
貸出増加支援									
当座預金増減	▲13,200		▲1,100		+18,000		+4,000		
当座預金残高	3,309,600		3,308,500		3,326,500		3,330,500		
準備預金残高	2,986,200		2,997,300		2,997,300		2,997,300		
積み終了先	2,497,300		2,497,300		2,497,300		2,497,300		共通担保(本店)
超過準備	2,497,300		2,497,300		2,497,300		2,497,300		共通担保(全店)
非準備先残高	323,400		323,400		323,400		323,400		国債買現先
準備預金進捗率	99.8%		99.8%		99.8%		99.8%		CP買現先
平均	45.2%		45.2%		45.2%		45.2%		成長基盤強化
乖離率	54.6%		54.6%		54.6%		54.6%		被災地金融機関支援
			予想込増減	▲1,100	予想込増減	+18,000	予想込増減	+4,000	ローンハード残高
			当預見込	3,308,500	当預見込	3,326,500	当預見込	3,330,500	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,198.800
12/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 4,400
12/30 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		
オフア	-0.030	-
レボ	-0.100	-0.095
ビット	-0.080	-
出来値	-	-
	-	-

(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%

12/28 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	98,652	-3,661	-1,052
	19,935	-	-
	78,717	-2,609	-

*出所: 営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

12/28 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,392,700

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.085	-0.075	-	-0.035	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-0.040	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.048	-0.067	-	-0.033	-0.035	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.093	-0.247	-	-0.105	-0.105	-0.107	-0.115	-	-0.161	-0.225	-0.228

§ 12/30 オフアのオペと市場動向予想

足許は▲0.086~+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。

12/30 の予定(国内)

19:30 12月の日銀当座預金残高増減要因と
金融調節実績速報(日銀)

12/30 の予定(海外)

米 12月のシカゴPMI

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	▲1,100	3,308,500	+3,308,500	-0.086	-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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	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				
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	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				
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	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				
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	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				
2016/12/12 ~ 2016/12/26	8,000	1,950	1,950	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				
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/11/28 ~ 2017/3/6	5,000	100	100	0.00%	固定金利	-	札割れ	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				
2016/11/28 ~ 2016/12/12	8,000	2,851	2,851	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				
2016/11/21 ~ 2016/12/5	8,000	1,510	1,510	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