

DAILY SIGNAL

平成28年12月15日(木)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/15 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは245兆9,000億円だった。
積み最終日となる本日の無担保コールON物は、朝方▲0.02%の出合いからスタートし、▲0.035～▲0.015%のレンジで取引された。
調達一巡後も出合の水準は変わらず、後場にかけて調整程度の出合が散見されて引けた。
積み最終日要因で加重平均金利は3日連続で上昇し、▲0.029%(前日対比+0.005%)となった。

(単位:億円)

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	2,459,000	+2,459,000

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/15 のオペ結果
	12/15(木)		12/16(金)		12/19(月)		12/20(火)		
債券	▲3,400		▲3,000		▲3,000		▲4,000		9:20
財政	+54,000		+3,600		▲4,000		+60,000		ノーオペ
過不足	+50,600		+600		▲7,000		+56,000		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				+16,300					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(12/15-12/16)
国債買現先									▲0.500% 全取 204億
共通担保(本店)					▲1,500	+1,600			12:50
共通担保(全店)									ノーオペ
CP買現先									13:00
CP等買入	▲800		▲200	+4,500					共通担保(全店)(固定金利)
社債等買入									(12/19-1/4)
ETF買入		+200		+500					0% 全取 1,600億
J-REIT買入									13:50
被災地金融機関支援									国債補完供給(12/15-12/16)
貸出									▲0.500% 全取 63億
国債補完供給	+700	▲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	▲13,000	+59,800							
当座預金増減	+97,200		+22,000		▲6,900		+56,000		
当座預金残高	3,238,500		3,260,500		3,253,600		3,309,600		
準備預金残高	2,907,200								
積み終了先	2,454,700								共通担保(本店)
超過準備	2,454,700								共通担保(全店)
非準備先残高	331,300								国債買現先
準備預金進捗率	100.0%								CP買現先
平均	100.0%		予想込増減	+22,000	予想込増減	▲6,900	予想込増減	+56,000	成長基盤強化
乖離率	0.0%		当預見込	3,260,500	当預見込	3,253,600	当預見込	3,309,600	被災地金融機関支援

来積み期間の所要準備額(積数) 2,122.300
12/16以降の残り積み立て額(残り所要)積数) 2,122.300
12/16以降の残り積み立て額(残り所要)平均) 70.700

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オファー	-0.020	-	-0.100	-0.100
ビッド	-0.050	-	0.000	-0.090
出来値	-	-	-	-

12/14 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,179,400**

(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
12/15	652(3M)	-0.3925%	-0.4196%
12/8	651(3M)	-0.3903%	-0.4032%
12/7	650(6M)	-0.3523%	-0.3603%

12/14 のコール市場残高(前日比)		
合計	94,824	+3,028
有担	19,515	+1,160
無担	75,309	+1,868

*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	-	-	-0.030	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.003	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.029	-	-	-0.018	-0.005	-	-0.030	-	-	-	-
東京レボレート	-0.080	-0.090	-	-0.100	-0.173	-0.162	-0.155	-	-0.150	-0.225	-0.228

§ 12/16 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。
共通担保オペはノーオペを予想する。

12/16 の予定(国内)

国債市場特別参加者会合(財務省)

12/16 の予定(海外)

米 住宅着工件数(11月)

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	+22,000	3,260,500	+3,260,500	-0.080	-0.030	-0.030	-0.010	-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)

期間	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	札割れ
2016/12/12 ~ 2016/12/28	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
2016/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	0.00%	固定金利	札割れ

共通担保資金供給(本店)

期間	オファー額	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	オファー額	応札額	落札額	按分率	平均レート	倍率
12/15 ~ 12/22	担保範囲内	403	403	1.080%	固定金利	-
12/8 ~ 12/15	担保範囲内	11	11	0.890%	固定金利	-

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