

# DAILY SIGNAL

平成29年1月13日(金)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

**§ 1/13 のオペと市場動向**

8時発表の準備預金残高見込みは249兆4,000億円だった。  
無担保コールON物は▲0.02%の出合いから始まった。  
その後は▲0.04～▲0.02%のレンジで取引された。  
調達一巡後はビットが薄くなり、▲0.07～▲0.06%で出合いが見られた。

	即日オペ種類	オフー額	準備残見込	着地残対比
8:00	-	-	2,494,000	+2,494,000

(単位:億円)

	日銀速報 1/13(金)		日銀予想 1/16(月)		当社需給予想 1/17(火) / 1/18(水)				1/13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	
券	+2,100		+2,600		+3,000		+2,000		9:20 ノーオペ
財政	▲6,700		▲39,100		▲2,000		+1,000		10:10 国庫短期証券買入(1/17-)
過不足	▲4,600		▲36,500		+1,000		+3,000		+0.006%按分(85.4%) 15,001億
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	11:50 国債補完供給(1/13-1/16) ▲0.500% 全取698億
国債買入				+7,400					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入						+15,000			13:00 ノーオペ
国債買現先									13:50 国債補完供給(1/13-1/16) ▲0.500% 全取131億
共通担保(本店)			▲1,500	+1,600					
共通担保(全店)									
CP買現先									
CP等買入	▲400		▲900						
社債等買入									
ETF買入		+100		+1,100					
J-REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+200	▲900	+900						
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		▲5,600		▲27,900		+16,000		+3,000	
当座預金残高		3,309,200		3,281,300		3,297,300		3,300,300	
準備預金残高		2,973,900							共通担保オペ当社予想
積み終了先		2,497,500			ノーオペ	ノーオペ		ノーオペ	共通担保(本店) 0
超過準備		2,497,500							共通担保(全店) 3,260
非準備先残高		335,300							国債買現先 0
準備預金進捗率		100.0%							CP買現先 0
平均		100.0%		予想込増減 ▲27,900		予想込増減 +16,000		予想込増減 +3,000	成長基盤強化 76,205
乖離率		0.0%		当預見込 3,281,300		当預見込 3,297,300		当預見込 3,300,300	被災地金融機関支援 5,090
									ロンハート残高 0

来 積み期間の所要準備額(積数) 2,229,400  
1/16以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 2,229,400  
1/16以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 71,900

	T/N	T+2		
無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C	
オフー	-0.030	-	-0.100	-0.120
ビット	-0.040	-	0.000	-0.095
出来値	-	-	-	-

1/12時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,361,700**

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	15年末実績	16年末実績	1/10
長期国債	282	361	363
CP等	2.2	2.3	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	6.9	11.1	11.3
J-REIT	0.27	0.36	0.36
貸出支援基金	31	41	41
国庫短期証券	43	50	48
その他とも資産計	383	476	477
銀行券	98	102	101
当座預金	253	330	330
その他とも負債・純資産計	383	476	477

**T-Billの入札結果(直近3回)**

入札日	回数	最高利回	平均利回
1/12	657(3M)	-0.2685%	-0.3086%
1/6	656(6M)	-0.3400%	-0.3501%
1/5	655(3M)	-0.3424%	-0.3618%

1/12のコール市場残高(前日比)			
合計	100,166	-	-679
有担	20,633	-	-299
無担	79,533	-	-380

\*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	-	-	-0.010	-0.035	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.000	-0.030	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.026	-	-	-0.007	-0.033	-	0.001	0.001	-	-	-
東京レボレート	-0.087	-0.096	-	-0.099	-0.101	-0.104	-0.110	-	-0.154	-0.225	-0.228

**§ 1/16 オフー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。  
共通担保オペはノーオペを予想する。

**1/16 の予定(国内)**

日銀支店長会議にて黒田総裁あいさつ  
14:00 地域経済報告[さくらレポート](日銀)  
17:00 12月の業態別の日銀当座預金残高(日銀)

**1/16 の予定(海外)**

米 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	
◎ ノーオペ	▲27,900	3,281,300	+3,281,300	-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	

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	オフー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率	期間	オフー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2017/1/16 ~ 2017/4/24	5,000	210	210	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
2017/1/16 ~ 2017/1/30	8,000	1,411	1,411	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
2017/1/10 ~ 2017/1/23	8,000	1,650	1,650	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
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	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
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	0.00%	固定金利	-	札割れ	<b>米ドル資金供給オペ</b>							
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	札割れ	期間	オフー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2016/12/12 ~ 2016/12/26	8,000	1,950	1,950	0.00%	固定金利	-	札割れ	1/12 ~ 1/20	担保範囲内	350	350	1.160%	固定金利	-	1.00
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	-	札割れ	1/6 ~ 1/12	担保範囲内	491	491	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