

# DAILY SIGNAL

平成28年12月13日(火)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 12/13 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは236兆7,000億円だった。無担保コールON物は、朝方▲0.025%の出しからスタートし、▲0.07～▲0.02%のレンジで取引された。前営業日より調達意欲は強く、一部▲0.015%での出しも見られた。調達一巡後も地合に変化は見られず、調整程度の出合が散見された。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,367,000	+2,367,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/13 のオペ結果
	12/13(火)		12/14(水)		12/15(木)		12/16(金)		
券	▲2,500		▲2,000		▲3,000		▲3,000		9:20
財政	+1,000		+27,000		+59,000		+2,000		ノーオペ
過不足	▲1,500		+25,000		+56,000		▲1,000		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		+11,300							10:40
国庫短期証券買入		+12,500							米ドル資金供給(12/15-12/22)
国債買現先									貸付利率1.080% 403百万米ドル
共通担保(本店)									CP等買入(12/16-)
共通担保(全店)									▲0.010%按分(41.7%) 4,484億
CP買現先									11:50
CP等買入	▲900		▲100						国債補充供給(12/13-12/14)
社債等買入			▲100						▲0.600% 全取 557億
ETF買入		+100		+400					12:50
J-REIT買入									ノーオペ
被災地金融機関支援									13:00
貸出									ノーオペ
国債補充供給	+200	▲600	+600						
米ドル供給用担保国債供給					▲9,600	+59,800			
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	+21,100		+25,800		+106,200		+3,500		
当座預金残高	3,115,600		3,141,400		3,247,600		3,251,100		
準備預金残高	2,798,900		2,362,600		2,362,600		2,362,600		共通担保(本店) 0
積み終了先	2,362,600		2,362,600		2,362,600		2,362,600		共通担保(全店) 3,770
超過準備	2,362,500		2,362,500		2,362,500		2,362,500		国債買現先 0
非準備先残高	316,700		316,700		316,700		316,700		CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%		99.9%		成長基盤強化 76,205
平均	93.3%		93.3%		93.3%		93.3%		被災地金融機関支援 5,052
乖離率	6.6%		6.6%		6.6%		6.6%		ロンハート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,122,300

12/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 100

12/14 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 0

	T/N	T+2
無担	ユーロ円	CP現先
レボG.C		
オファー	0.000	-0.100
レボG.C	-0.090	-0.090
ビッド	-0.050	0.000
レボG.C	-0.080	-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	12/10
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	回数	最高利回	平均利回
12/8	651(3M)	-0.3903%	-0.4032%
12/7	650(6M)	-0.3523%	-0.3603%
12/1	649(3M)	-0.3330%	-0.3408%

12/12 のコール市場残高(前日比)

	合計	92,734	+2,883
有担	21,376	-809	
無担	71,358	+3,692	

\*出所:営業毎旬報告  
\*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

12/12 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,128,000

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	-	-	-0.025	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.001	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.043	0.000	-	-0.012	-	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.096	-0.087	-	-0.100	-0.106	-0.161	-0.154	-	-0.150	-0.225	-0.228

## § 12/14 オファ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。

## 12/14 の予定(国内)

8:50 日銀短観(12月)

## 12/14 の予定(海外)

米 FOMC声明と経済予測発表

FRB議長の会見

週間のMBA住宅ローン申請指数

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
◎	ノーオペ	+25,800	3,141,400	+3,141,400	-0.070	-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)					*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				
2016/12/12 ~ 2016/12/26	8,000	1,950	1,950	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				
2016/12/5 ~ 2016/12/19	8,000	1,510	1,510	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				
2016/11/28 ~ 2017/3/6	5,000	100	100	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				
2016/11/28 ~ 2016/12/12	8,000	2,851	2,851	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				
2016/11/21 ~ 2016/12/5	8,000	1,510	1,510	0.00%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ											
2016/11/14 ~ 2016/11/28	8,000	1,901	1,901	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				
2016/11/7 ~ 2016/11/21	8,000	1,400	1,400	0.00%	固定金利	-	札割れ	12/15 ~ 12/22	担保範囲内	403	403	1.080%	固定金利	-	1.00				
2016/10/31 ~ 2016/11/14	8,000	2,660	2,660	0.00%	固定金利	-	札割れ	12/8 ~ 12/15	担保範囲内	11	11	0.890%	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