

# DAILY SIGNAL

平成28年12月30日(金)  
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 12/30 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは247兆1,000億円だった。  
年末初物となる無担保コールON物は▲0.065%の出合から始まり、その後は  
▲0.08～▲0.035%のレンジで取引される展開となった。後場に入って▲0.08%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	-	-	2,471,000	+2,471,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/30 のオペ結果
	12/30(金)		1/4(水)		1/5(木)		1/6(金)		
券	+100		+5,500		+6,000		+5,000		9:20
財政	▲6,900		+900		▲2,000		▲25,000		ノオベ
過不足	▲6,800		+6,400		+4,000		▲20,000		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	ノオベ
国債買入		+4,100		+12,400					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給(12/30-1/4)
国債買現先									▲0.500% 全取 5,949億
共通担保(本店)			▲1,600	+1,300					12:50
共通担保(全店)									ノオベ
CP買現先	▲3,800	+4,500							13:00
CP等買入									ノオベ
社債等買入									13:50
ETF買入		+700		+300					国債補完供給(12/30-1/4)
J-REIT買入									▲0.500% 全取 65億
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給	+200	▲6,100	+6,100						
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	▲7,200		+24,900		+4,000		▲20,000		
当座預金残高	3,302,400		3,327,300		3,331,300		3,311,300		
準備預金残高	2,953,700								
積み終了先	2,462,000								共通担保(本店)
超過準備	2,461,700								共通担保(全店)
非準備先残高	348,700								国債買現先
準備預金進捗率	99.9%								CP買現先
平均	61.3%		予想込増減	+24,900	予想込増減	+4,000	予想込増減	▲20,000	成長基盤強化
乖離率	38.6%		当預見込	3,327,300	当預見込	3,331,300	当預見込	3,311,300	被災地金融機関支援
									ロンバート残高

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,202,100  
1/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,800  
1/4 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 100

	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	-	-0.095
レボ	-	0.000
レボ	-	-0.085
出来値	-	-

12/29 時点のマネタリーベース(単位:億円) **4,381,700**

(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%

## 12/29 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	97,138	-1,514	
	20,868	+933	
	76,270	-2,447	

\*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	-0.086	-	-	-	-0.050	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-0.035	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.058	0.000	-	-0.040	-0.043	-	-	-	-	-	-
東京レボレート	-0.194	-0.090	-	-0.100	-0.101	-0.104	-0.112	-	-0.157	-0.225	-0.228

## § 1/4 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。  
共通担保オペはノオベを予想する。

## 1/4 の予定(国内)

特になし

## 1/4 の予定(海外)

米 週間MBA住宅ローン申請指数  
12月13～14日のFOMC議事録

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	+24,900	3,327,300	+3,327,300	-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)

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
2017/1/4 ~ 2017/1/16	8,000	1,300	1,300	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/12/26 ~ 2017/1/10	8,000	2,652	2,652	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/12/19 ~ 2017/1/4	8,000	1,600	1,600	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/12/12 ~ 2016/12/26	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

## 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	按分率	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%	1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
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	按分率	倍率
12/30 ~ 1/6	担保範囲内	1,223	1,223	1.060%	固定金利	-	1.00
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