

# DAILY SIGNAL

平成25年3月26日(火)

上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

## § 3/26 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは40兆3000億円であった。  
本日の無担ONは朝方0.07%の出会いからスタート、その後は0.05~0.065%の水準で推移した。その後も弱含み、一部0.04%の出会いも見られ引けた。本日は試し取りと見られる調達もあり、0.120%の出会いが散見された。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	403,000	+403,000

(単位:億円)

	日報速報 3/26(火)		日報予想 3/27(水)		当社需給予想				3/26 のオペ結果
	エンド	スタート	エンド	スタート	3/28(木)		3/29(金)		
券		▲200		▲1,600		▲1,000		▲1,000	9:20
財政		+6,200		▲2,100		+15,000		+12,000	ノーオペ
過不足		+6,000		▲3,700		+14,000		+11,000	10:10
金融調節									ノーオペ
国債買入									10:40
国債買現先									米ドル資金供給
共通担保(本店)									(3/28-4/4) 利率0.640%
共通担保(全店)									0百万米ドル
CP買現先									12:50
手形売出									ノーオペ
貸出									13:00
成長基盤強化支援									共通担保(資産買入等基金)
国債補充供給									(3/28-4/25)
被災地金融機関支援									4550億円(札割れ)
資産買入等基金									
		▲8,000		▲8,000		▲4,200		▲4,700	
		+8,000		+4,300		+4,600			
				+6,000					
		▲200		▲300					
				+3,700					
				▲100					
				+300					
当座預金増減		+21,100		+1,900		+14,400		+6,300	
当座預金残高		558,400		560,300		574,700		581,000	3/26 の日報オペ等残高
準備預金残高		494,000							共通担保(本店) 0
積み終了先		338,200	ノーオペ		ノーオペ				共通担保(全店) 0
超過準備		338,200							国債買現先 0
非準備先残高		64,400							CP買現先 0
準備預金進捗率		81.3%							成長基盤強化 33,529
平均		35.5%	予想込増減	+1,900	予想込増減	+14,400	予想込増減	+14,300	被災地金融機関支援 4,309
乖離率		45.8%	当預見込	560,300	当預見込	574,700	当預見込	589,000	ローンパート残高 0

今積み期間の所要準備額(積数) 1,767,900  
3/27以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 330,100  
3/27以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 16,500

資産買入等基金運営状況	残高(億円)	12年12月末	13年6月末	13年12月末
共通担保オペ	222,211	25.0兆円	25.0兆円	25.0兆円
国債買入	268,817	24.0兆円	34.0兆円	44.0兆円
国債短期証券買入	153,654	9.5兆円	19.5兆円	24.5兆円
CP等買入	20,538	2.1兆円	2.1兆円	2.2兆円
社債等買入	29,474	2.9兆円	2.9兆円	3.2兆円
ETF買入	15,153	1.6兆円	1.6兆円	2.1兆円
J-REIT買入	1,160	0.12兆円	0.12兆円	0.13兆円
合計	711,007	65兆円程度	85.5兆円程度	101兆円程度

\*買入残高は日報営業毎旬報告ベース \*積み上げ完了の目途

T-Billの入札結果(直近3回)				
入札日	回号	最高利回	平均利回	
3/26	355(3M)	0.0403%	0.0395%	
3/21	354(3M)	0.0421%	0.0417%	
3/19	353(2M)	0.0463%	0.0451%	
3/25のコール市場残高(前日比)				
合計	228,432		+5,439	
有担	158,232		+7,151	
無担	70,200		-1,712	

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.080	0.090	0.02
ビッド	0.060	0.030	0.108	0.05
出来値	0.070	-	0.103	-

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	0.040	0.055	-	0.118	-	-	-	-	-	-	-
最高	0.150	0.120	-	0.150	-	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.076	0.068	-	0.124	-	-	-	-	0.200	-	-
東京レボ・レート	0.062	0.030	-	0.093	0.096	0.099	0.099	-	0.100	0.100	0.100

## § 3/27 オフアのオペと市場動向予想

明日の無担ONは0.05~0.07%近辺で取引されるだろう。  
29日の基金による共通担保オペはロールオフアを予想する。

## 3/27 の予定(国内)

特になし

## 3/27 の予定(海外)

米国 MBA住宅ローン申請指数  
欧州 3月消費者物価指数速報  
3月消費者信頼感指数確定値

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出会いレンジ予想								
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	+1,900	560,300	+560,300	0.050	0.117	0.118	0.118	0.119	0.120	0.125	0.140	0.150
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.125	0.125	0.125	0.125	0.130	0.140	0.150	0.200	0.300

### 共通担保資金供給(本店)

### \*当日物

### 共通担保資金供給(資産買入等基金)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
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
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
共通担保資金供給(全店)							
期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
2012/3/2 ~ 2012/4/4	10,000	7,710	7,710	0.10%	0.100%	-	札割れ
2012/3/1 ~ 2012/3/29	8,000	13,320	8,008	0.10%	0.100%	60.1%	1.66
2012/2/29 ~ 2012/3/26	10,000	21,270	10,008	0.10%	0.100%	47.1%	2.13
2012/2/23 ~ 2012/3/22	10,000	35,810	10,010	0.10%	0.100%	28.0%	3.58

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
3/28 ~ 4/25	8,000	4,550	4,550	0.10%	固定金利	-	札割れ
3/27 ~ 4/24	8,000	4,310	4,310	0.10%	固定金利	-	札割れ
3/26 ~ 4/18	8,000	8,800	8,004	0.10%	固定金利	91.0%	1.10
3/25 ~ 4/16	8,000	11,258	8,008	0.10%	固定金利	71.1%	1.41
3/22 ~ 4/15	8,000	11,444	8,005	0.10%	固定金利	69.9%	1.43
3/21 ~ 4/12	8,000	11,498	8,006	0.10%	固定金利	69.6%	1.44
米ドル資金供給オペ							
期間	オフア額	応札額	落札額	按分レト	平均レト	按分率	倍率
3/21 ~ 3/28	担保範囲内	2	2	0.650%	固定金利	-	1.00
3/14 ~ 3/21	担保範囲内	2	2	0.660%	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