

DAILY SIGNAL

平成25年11月18日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 11/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは78兆円だった。
朝方無担保コールON物は0.07%台の出会いから始まり、その後も
同水準で取引された。後場に入るとビッドは薄くなり、調整程度の
出会いが散見されて引けた。一部で0.10%超の試し取りが見られた。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	780,000	+780,000

(単位: 億円)

	日銀速報 11/18(月)		日銀予想 11/19(火)		当社需給予想				11/18 のオペ結果
	11/18(月)	11/19(火)	11/20(水)	11/21(木)	11/20(水)		11/21(木)		
券	+700	+500	▲1,000	▲2,000					9:20 ノーオペ
財政	▲47,800	+5,500	▲16,000	▲12,000					9:30 CP等買入(11/21-)
過不足	▲47,100	+6,000	▲17,000	▲14,000					0.058%按分(42.7%) 3956億
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	10:10 国債買入(11/20-)
国債買入			+7,100			+4,200			(残存5年超10年以下)
国庫短期証券買入			+20,000						+0.008%按分(73.2%) 4007億
国債買現先									(物価連動債)
共通担保(本店)	▲4,600	+2,900							▲0.310円按分(31.6%) 203億
共通担保(全店)									
CP買現先									12:50 ノーオペ
CP等買入	▲400		▲100						13:00 ノーオペ
社債等買入		+1,500							
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援									
貸出									14:00 国債補充供給
国債補充供給									(11/18-11/19)
成長基盤強化支援									▲0.400%(全取) 30億
貸出増加支援									
当座預金増減	▲47,700	+33,000	▲12,800	▲10,000					
当座預金残高	978,000	1,011,000	998,200	988,200					
準備預金残高	884,600				当社オペ予想				共通担保(本店) 0
積み終了先	593,500				ノーオペ	ノーオペ	ノーオペ		共通担保(全店) 160,033
超過準備	527,100								国債買現先 0
非準備先残高	93,400								CP買現先 0
準備預金進捗率	79.8%								成長基盤強化 34,047
平均	10.0%				予想増減 +33,000	予想増減 ▲12,800	予想増減 ▲10,000		被災地金融機関支援 3,806
乖離率	69.8%				当預見込 1,011,000	当預見込 998,200	当預見込 988,200		ロンバート残高 0

今積み期間の所要準備額(積数) 1,783.800
11/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 359.600
11/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 13.300

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	0.05	0.080	0.095
ビッド	0.070	0.04	0.090	0.105
出来値	-	0.04	0.085	-

11/15 時点のマネタリーベース(単位: 億円) 1,907.700

マネタリーベースは12年末実績138兆円、13年末見通し200兆円
14年見通し270兆円。
(参考)日銀B/S(単位: 兆円)

	実績			
	12年末	11/10	13年末	14年末
長期国債	89	135	140	190
CP等	2.1	1.8	2.2	2.2
社債等	2.9	3.2	3.2	3.2
ETF	1.5	2.4	2.5	3.5
J-REIT	0.11	0.139	0.14	0.17
貸出支援基金	3.3	8.0	13	18
その他とも資産計	158	218	220	290
銀行券	87	84	88	90
当座預金	47	101	107	175
その他とも負債・純資産計	158	218	220	290

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
11/18	411(1Y)	0.0580%	0.0550%
11/14	410(3M)	0.0540%	0.0521%
11/7	409(3M)	0.0588%	0.0596%
11/15 のコール市場残高(前日比)			
合計	182,505	-2,155	
有担	123,461	+2,686	
無担	59,044	-4,841	

*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	0.060	0.071	-	-	0.115	-	-	-	-	-	-
最高	0.125	0.120	-	-	0.185	-	-	-	-	-	-
加重平均	0.073	0.082	-	0.130	0.154	-	-	-	-	-	-
東京レボ・レート	0.091	0.098	-	0.094	0.094	0.094	0.094	-	0.097	0.099	0.099

§ 11/19 オフアのオペと市場動向予想

足許金利は0.07%を中心に取引されよう。
共通担保オペは期落ち分もなく見送られると予想する。

11/19 の予定(国内)

14:30 10月全国百貨店売上高(百貨協)
日本EU定期首脳会議(都内)

11/19 の予定(海外)

米 FRBバーナンキ議長講演
独 11月ZEW景況感調査

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	+33,000	1,011,000	+1,011,000	0.050	0.075	0.075	0.075	0.100	0.117	0.118	0.130	0.200
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.125	0.130	0.135	0.140	0.145	0.150	0.155	0.180	0.300

共通担保資金供給(全店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
2013/11/18 ~ 2014/2/19	8,000	2,860	2,860	0.10%	固定金利	-	札割れ
2013/11/13 ~ 2014/2/17	8,000	1,750	1,750	0.10%	固定金利	-	札割れ
2013/11/11 ~ 2014/2/10	8,000	2,440	2,440	0.10%	固定金利	-	札割れ
2013/11/5 ~ 2014/2/5	8,000	400	400	0.10%	固定金利	-	札割れ
2013/11/1 ~ 2014/2/3	8,000	1,040	1,040	0.10%	固定金利	-	札割れ
2013/10/28 ~ 2014/2/24	8,000	2,669	2,669	0.10%	固定金利	-	札割れ
2013/10/21 ~ 2014/2/17	8,000	2,625	2,625	0.10%	固定金利	-	札割れ
2013/10/15 ~ 2014/2/10	8,000	765	765	0.10%	固定金利	-	札割れ

*当日物

共通担保資金供給(本店)

期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	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
米ドル資金供給オペ							
期間	オフア額	応札額	落札額	按分レド	平均レド	按分率	倍率
11/15 ~ 2/6	担保範囲内	0	0	0.590%	固定金利	-	応札なし
11/15 ~ 11/21	担保範囲内	1	1	0.590%	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