

DAILY SIGNAL

平成26年12月29日(月)
上田八木短資株式会社 TEL0120-327-017

§ 12/29 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは130兆4000億円。
無担ON物は朝方0.066%の出会いから始まり、その後0.06%台後半で推移した。
後場に入り、一部0.07%台の出会いが見られ引けた。
年末初物となるTNは特段出合いは見られず、ターム物は1Mで0.11%台後半の
出合いとなった。

	即日オペ種類	オフア額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	1,304,000	+1,304,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				12/29 のオペ結果
	12/29(月)		12/30(火)		1/5(月)		1/6(火)		
券	▲4,300		▲700		+7,000		+7,000		9:20
財政	▲4,200		▲5,200		+1,000		▲4,000		ノーオペ
過不足	▲8,500		▲5,900		+8,000		+3,000		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				+5,600					11:50
国庫短期証券買入									国債補完供給
国債買現先									(12/29-12/30)
共通担保(本店)					▲3,300	+2,400			▲0.400%(全取) 10億
共通担保(全店)									
CP買現先									12:50
CP等買入	▲400		▲5,600	+5,000					ノーオペ
社債等買入									13:00
ETF買入				+700					共通担保オペ(全店)(固定金利方式)
J-REIT買入									(1/5-4/6)
被災地金融機関支援									0.10%(全取) 2400億
貸出									
国債補完供給	+100								
成長基盤強化支援									
貸出増加支援									
当座預金増減	▲8,800		▲200		+7,100		+3,000		
当座預金残高	1,781,800		1,781,600		1,788,700		1,791,700		
準備預金残高	1,614,700		1,614,700		1,614,700		1,614,700		
積み終了先	1,303,200		1,303,200		1,303,200		1,303,200		共通担保(本店) 0
超過準備	1,302,000		1,302,000		1,302,000		1,302,000		共通担保(全店) 79,571
非準備預金残高	167,100		167,100		167,100		167,100		国債買現先 0
準備預金進捗率	98.7%		98.7%		98.7%		98.7%		CP買現先 0
平均	45.2%		45.2%		45.2%		45.2%		成長基盤強化 44,120
乖離率	53.5%		53.5%		53.5%		53.5%		被災地金融機関支援 3,251
			予想込増減 ▲200	予想込増減 ▲200	予想込増減 +7,100	予想込増減 +7,100	予想込増減 +3,000	予想込増減 +3,000	ロンハート残高 0
			当預見込 1,781,600	当預見込 1,781,600	当預見込 1,788,700	当預見込 1,788,700	当預見込 1,791,700	当預見込 1,791,700	

今 積み期間の所要準備額(積数) 1,963,700
12/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 25,500
12/30 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オフア	0.120	-	0.080	0.095
ビッド	0.060	-	0.097	0.102
出来値	-	-	0.093	-

12/26 時点のマナターベース(単位:億円) **2,763,200**

マナターベースの 2014年末 見通しは 275兆円

(参考)日銀/S(単位:兆円)	13年末実績	12/20	14年末見通し
長期国債	142	202	200
CP等	2.2	2.7	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	2.5	3.8	3.8
J-REIT	0.14	0.18	0.18
貸出支援基金	9.2	25	18
国庫短期証券	40	52	-
その他とも資産計	224	304	297
銀行券	90	91	93
当座預金	107	175	177
その他とも負債・純資産計	224	304	297

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
12/18	502(3M)	-0.0018%	-0.0063%
12/17	501(1Y)	-0.0040%	-0.0050%
12/11	500(3M)	-0.0018%	-0.0040%

12/26 のコール市場残高(前日比)			
	合計	有担	無担
	186,482	-7,529	-
	120,638	-7,255	-
	65,844	-274	-

*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	0.050	0.055	-	0.118	-	-	0.118	-	-	-	-
最高	0.125	0.170	-	0.260	-	-	0.145	-	-	-	-
加重平均	0.068	0.109	-	0.166	0.145	-	0.118	-	-	-	-
東京レボレート	0.063	0.092	-	0.043	0.042	0.042	0.042	-	0.036	0.048	0.058

§ 12/30 オフアのオペと市場動向予想

年末初物となる明日のONは0.05~0.06%台前半で取引
されよう。共通担保オペはノーオペを予想する。

12/30 の予定(国内)

与党が来年度税制改正大綱を発表
19:30 12月日銀当座預金増減要因と金融調節
実績速報(日銀)

12/30 の予定(海外)

米 10月のS&Pケース・ラー住宅価格指数
12月の消費者信頼感指数

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	▲200	1,781,600	+1,781,600	0.030	0.070	0.070	0.070	0.075	0.090	0.118	0.125	0.200
					~	~	~	~	~	~	~	~	~
					0.125	0.125	0.130	0.135	0.140	0.145	0.150	0.170	0.300

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	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率	期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率
2015/1/5 ~ 2015/4/6	8,000	2,400	2,400	0.10%	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	2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2014/12/22 ~ 2015/3/23	8,000	1,031	1,031	0.10%	固定金利	-	札割れ	2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,003	0.10%	0.100%	40.6%	2.46	2012/3/5 ~ 2012/3/26	8,000	13,570	8,008	0.10%	0.100%	59.0%	1.70
2014/12/12 ~ 2015/3/24	10,000	3,810	3,810	0.10%	固定金利	-	札割れ	米ドル資金供給オペ					期間	オフア額	応札額	落札額	按分率	平均レート	按分率	倍率			
2014/12/9 ~ 2015/3/20	10,000	5,655	5,655	0.10%	固定金利	-	札割れ	12/29 ~ 1/8	担保範囲内	1,528	1,528	0.630%	固定金利	-	1.00	12/18 ~ 12/29	担保範囲内	30	30	0.600%	固定金利	-	1.00
2014/12/8 ~ 2015/3/9	8,000	1,350	1,350	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2014/12/1 ~ 2015/3/2	8,000	2,070	2,070	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2014/11/25 ~ 2015/2/23	8,000	2,650	2,650	0.10%	固定金利	-	札割れ																
2014/11/17 ~ 2015/2/16	8,000	3,370	3,370	0.10%	固定金利	-	札割れ																

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