

東京短資デイリーレポート

2023/11/27

<11月24日のマネタリーベース>

6,698,100

<11月27日9時20分日銀オペ後の状況>

9時20分の日銀オペ	ノーオペ
日銀発表の日銀当座預金残高	5,479,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,442,400
日銀当座預金残高増減前日比	+37,500

<11月27日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給実績		
銀行券要因		-200
財政等要因		-4,500
資金過不足		-4,700
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-400	
社債等買入	-800	
国債補完供給	+42,700	-41,800
金融調節合計		-300
当座預金増減-②		-5,000

<11月27日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,437,400
準備預金残高	4,757,500
積み終了先	4,755,100
超過準備	4,755,100
非準備先残高	679,900

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,891,200
今積み期間所要準備額 (平均)	129,700
残り要積立額 (積数)	15,800
残り要積立額 (平均)	900
準備進捗率(%)	99.5
日数進捗率(%)	40.0
進捗率乖離幅	+59.5

<11月28日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給予想		
銀行券要因		-500
財政等要因		-4,100
資金過不足		-4,600
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-400	
国債補完供給	+41,800	
金融調節合計		+41,400
当座預金増減		+36,800

<11月28日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆4,200億円)で 無担保コール0/Nは-0.020%~-0.010% での合いが中心か。

<11月28日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,519,200	+81,800
+40,000	5,514,200	+76,800
+35,000	5,509,200	+71,800
+30,000	5,504,200	+66,800
+25,000	5,499,200	+61,800
+20,000	5,494,200	+56,800
+15,000	5,489,200	+51,800
+10,000	5,484,200	+46,800
+5,000	5,479,200	+41,800
± 0	5,474,200	+36,800
-5,000	5,469,200	+31,800
-10,000	5,464,200	+26,800
-15,000	5,459,200	+21,800
-20,000	5,454,200	+16,800
-25,000	5,449,200	+11,800
-30,000	5,444,200	+6,800
-35,000	5,439,200	+1,800
-40,000	5,434,200	-3,200
-45,000	5,429,200	-8,200

<11月27日 日銀オペ入札結果>

※スペースの関係上、内容を省略する場合があります。詳細は弊社HPをご参照ください。

(10:40) C P買入	23/11/30	4,000億	応札 7,186億	落札 3,986億	最低 0.000%	平均 +0.027%	按分 50.1%
(11:50) 国債補完供給	23/11/27-23/11/28		応札 42,507億	落札 42,507億	全取 -0.350%	平均 -0.351%	
(13:50) 国債補完供給	23/11/27-23/11/28		応札 0億	落札 0億			

<11月27日 各オペ残高と内訳> (カッコ内は先日付スタート・#印はエンドが13時同時処理)

共通担保(全店)固定金利	国債買入額(月初末)	貸出支援基金の運営として行うオペレーション	被災地金融機関支援資金供給			
97,581	61,582	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給			
11/22-12/6 6,360.	11/24(1-3Y) 3,759.	45,909	776,646	2/18~ 2/16 0.		
1/6~ 1/6 20,014.	11/24(3-5Y) 4,501.	12/4-12/4 10,258.	12/16-12/15 20,601.	5/17~ 5/17 0.		
1/5~ 1/6 10,016.	11/24(5-10Y) 5,257.	3/4~ 3/4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	8/19~ 8/19 381.		
1/10~ 1/10 20,011.	11/24(25Y-) 753.	6/3~ 6/3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18~11/18 93.		
1/13~ 1/14 20,008.		9/2~ 9/2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.		
1/16~ 1/16 20,009.		12/2-12/2 1,712.		5/12~ 5/12 181.		
1/19~ 1/20 1,163.		3/3~ 3/3 6,793.		8/18~ 8/18 0.		
		6/2~ 6/2 2,644.		11/17-11/17 0.		
		9/1~ 9/1 5,024.				
			※直近約1年分の期落ち分を記載			
			米ドル資金供給オペ			
			2百万ドル			
			11/24-11/30 2.			
			※直近約1年分の期落ち分を記載			
			成長基盤強化支援米ドル特別			
			16,708百万ドル			
			12/2-12/4 3,607.		気候変動対応支援資金供給	
			3/3~ 3/4 2,153.		62,659	
			6/2~ 6/3 5,566.		1/30~ 1/30 28,261.	
			9/5~ 9/5 5,382.		7/21~ 7/19 34,398.	
			国債買現先オペ			
			0			
			国債売現先(米ドルオペ用担保)			
			2			
			11/22-12/1 2.			
			国庫短期証券買入額(月初末)			
			国債売現先オペ			
			2,000			
			0			
			11/8 1,000.			
			11/22 1,000.			
			CP買入額(月初末)			
			3,995			
			11/14 3,995.			
			(11/30 3,986.)			
			社債買入額(月初末)			
			1,000			
			11/21 1,000.			
			ETF買入額			
			356,921			
			約定 23/10/4 701.			
			ETF買入額(企業支援)			
			14,628			
			約定 21/3/31 12.			
			J-REIT買入額			
			6,823			
			約定 22/6/14 12.			
			※直近約1週間の実施分を記載			
			国債補完供給			
			42,507			
			11/27-11/28 42,507.			
			11/27-11/28 0.			
			ETF買入額			
			356,921			
			約定 23/10/4 701.			
			ETF買入額(企業支援)			
			14,628			
			約定 21/3/31 12.			
			J-REIT買入額			
			6,823			
			約定 22/6/14 12.			
			※直近約1週間の実施分を記載			
			国債買入額(月初末)			
			0			
			※直近約1週間の実施分を記載			
			成長基盤強化支援資金供給の各オペは、貸付日・返済期日が同じ場合まとめて表示しています。			
			ETF・J-REIT買入は、買入総額と直近の買入を表示しています。 共通担保・成長基盤強化支援・貸出増加支援の各資金供給オペの貸付残高は、期日前返済による減少があるため、貸付額の合計とは必ずしも一致しません。			
			国債買現先			
			0			
			被災地金融機関支援			
			1,001			
			気候変動対応支援			
			62,648			
			成長基盤支援			
			39,647	手形売出	0	
			貸出増加支援	702,255	国債売現先	0
			供給オペ合計	973,167	国債補完供給	42,507
			貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	2
			供給額合計	973,167	吸収額合計	42,509
			差し引き	930,658		

<11月27日のオープン市場気配レート(単位:%)>

NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
S/N	0.000	1M	-----	3M	買気配 -0.150
1W	売気配 -0.020	2M	+0.050000	6M	買気配 -0.150
2W	売気配 -0.020	3M	0.000000	1Y	買気配 -0.050
1M	売気配 -0.020				

<11月24日のJ-REIT市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	192,440	-8,291
有担保	26,713	+396
無担保	165,727	-8,687

<11月27日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

	無担保コール				有担保コール				東京レポレート	
	最低	最高	平均	前日比	最低	最高	平均	前日比	平均値	前日比
翌日物	-0.087	0.001	-0.017	-0.005				-----	-0.077	+0.008
トムネ				-----				-----	-0.097	+0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.040	-0.020	-0.033	-0.004				-----	-0.131	+0.001
2週間物				-0.003	+0.009			-----	-0.142	+0.005
3週間物				-----				-----	-0.157	+0.002
1ヶ月物				-----				-----	-0.172	± 0
3ヶ月物				0.020	-0.005			-----	-0.192	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	-0.116	+0.004
1年物				-----				-----	-0.078	+0.002

本資料は情報提供を目的としてのみ作成されたものであり、お取引の最終決定は御自身の判断でなされますようお願いいたします。
本資料に記載されている内容は、信頼できる情報源に基づき作成されたものですが、弊社はその正確性および確実性を保証するものではありません。
非上場債券(国債、CP等)を当社が相手方となりお買付けいただく場合は、購入対価のみお支払いいただきます。
債券は、金利水準の変化等により価格が上下し、損失が生じるおそれがあります。
商号等：東京短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第524号 加入協会：日本証券業協会