

東京短資テイリーレポート

2023/12/5

<12月4日のマネタリーベース>

6,572,500

<12月5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	5,368,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,313,600
日銀当座預金残高増減前日比	+54,500

<12月5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		-1,000
財政等要因		+2,700
資金過不足		+1,700
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+10,300
CP等買入	-200	
国債補充供給	+43,500	-40,900
金融調節合計		+12,700
当座預金増減-②		+14,400

<12月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,328,000
準備預金残高	4,642,800
積み終了先	4,642,400
超過準備	4,642,100
非準備先残高	685,200

<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)	3,400
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	66.7
進捗率乖離幅	+33.2

<12月6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		-1,200
財政等要因		-32,400
資金過不足		-33,600
金融調節確定分		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
共通担保(全店)	-6,400	+6,300
CP等買入	-100	
社債等買入	-300	
国債補充供給	+40,900	
金融調節合計		+41,400
当座預金増減		+7,800

<12月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残533兆5,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.010% での合いが中心か。

<12月6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	5,380,800	+52,800
+40,000	5,375,800	+47,800
+35,000	5,370,800	+42,800
+30,000	5,365,800	+37,800
+25,000	5,360,800	+32,800
+20,000	5,355,800	+27,800
+15,000	5,350,800	+22,800
+10,000	5,345,800	+17,800
+5,000	5,340,800	+12,800
± 0	5,335,800	+7,800
-5,000	5,330,800	+2,800
-10,000	5,325,800	-2,200
-15,000	5,320,800	-7,200
-20,000	5,315,800	-12,200
-25,000	5,310,800	-17,200
-30,000	5,305,800	-22,200
-35,000	5,300,800	-27,200
-40,000	5,295,800	-32,200
-45,000	5,290,800	-37,200

<12月5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。

(10:10) 国庫短期証券買入	23/12/ 6	1,000億	応札 3,617億	落札 1,001億	最低 +0.005%	平均 +0.008%	按分 5.9%
(10:40) ミドル資金供給	23/12/ 7-23/12/14		応札 2ml	落札 2ml			貸付 5.580%
(11:50) 国債補充供給	23/12/ 5-23/12/ 6		応札 41,181億	落札 41,181億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(13:00) 共通担保(全店)	23/12/ 6-23/12/19		応札 6,294億	落札 6,294億			貸付 0.000%
(13:50) 国債補充供給	23/12/ 5-23/12/ 6		応札 0億	落札 0億			

<12月5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)	貸出支援基金の運用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
9 7, 5 8 1	1 0, 5 1 5	成長基盤強化支援資金供給	1, 0 0 1
11/22-12/ 6	11/30(3-5Y)	3 5, 6 5 1	7 7 6, 6 4 6
(12/ 6-12/19	11/30(5-10Y)	3/ 4~ 3/ 4	2,178.
6, 294.)	5,255.	12/16-12/15	20,601.
1/ 5~ 1/ 6	11/30(10-25Y)	3/18~ 3/18	41,458.
10,016.	2,001.	6/19~ 6/19	63,179.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.
11/30(物国)	600.	12/ 2-12/ 2	1,712.
1/10~ 1/10	12/ 5(1-3Y)	9/16~ 9/13	132,310.
20,011.	3,751.		
1/13~ 1/14	12/ 5(3-5Y)		
20,008.	4,506.		
1/16~ 1/16	12/ 5(10-25Y)		
20,009.	1,505.		
1/19~ 1/20	12/ 5(25Y)		
1,163.	753.		

※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。

<12月5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 -0.140
1W	売気配 -0.020	2M	+0.020000	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 -0.050
1M	売気配 -0.020				

<12月4日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	197,462	-1,023
有担保	30,124	+1,376
無担保	167,338	-2,399

<12月5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	-0.011	+0.002					-0.077	+0.008
トムネ				-----					-0.086	+0.014
スポネ				-----						
1週間物				-----					-0.115	+0.007
2週間物	-0.025	-0.001	-0.017	+0.010					-0.131	+0.003
3週間物	-0.023	0.001	-0.021	-----					-0.142	+0.005
1ヶ月物				-----					-0.177	+0.009
3ヶ月物				-----					-0.173	+0.005
6ヶ月物				-----					-0.119	-0.001
1年物				-----					-0.079	± 0

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