

東京短資テイリーレポート

2023/12/8

<12月7日のマネタリーベース>

6,562,000

<12月8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	5,334,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,298,800
日銀当座預金残高増減前日比	+35,400

<12月8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		-1,600
財政等要因		-1,600
資金過不足		-3,200
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-200	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+37,800	-37,200
金融調節合計		+300
当座預金増減-②		-2,900

<12月8日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,295,900
準備預金残高	4,621,200
積み終了先	4,621,000
超過準備	4,620,900
非準備先残高	674,700

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,895,300
今積み期間所要準備額 (平均)	129,800
残り要積立額 (積数)	1,700
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	83.3
進捗率乖離幅	+16.6

<12月11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		-1,000
財政等要因		-13,300
資金過不足		-14,300
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+14,800
国債補完供給	+37,200	
金融調節合計		+52,000
当座預金増減		+37,700

<12月11日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残533兆3.600億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.010% での合いが中心か。

<12月11日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,378,600	+82,700
+40,000	5,373,600	+77,700
+35,000	5,368,600	+72,700
+30,000	5,363,600	+67,700
+25,000	5,358,600	+62,700
+20,000	5,353,600	+57,700
+15,000	5,348,600	+52,700
+10,000	5,343,600	+47,700
+5,000	5,338,600	+42,700
± 0	5,333,600	+37,700
-5,000	5,328,600	+32,700
-10,000	5,323,600	+27,700
-15,000	5,318,600	+22,700
-20,000	5,313,600	+17,700
-25,000	5,308,600	+12,700
-30,000	5,303,600	+7,700
-35,000	5,298,600	+2,700
-40,000	5,293,600	-2,300
-45,000	5,288,600	-7,300

<12月8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) 国債買入(1Y-3Y)	23/12/11	3,750億 応札 5,898億 落札 3,750億 最低 +0.007% 平均 +0.012% 按分 18.0%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/12/11	4,500億 応札 10,512億 落札 4,505億 最低 +0.031% 平均 +0.034% 按分 18.3%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/12/11	5,250億 応札 5,915億 落札 5,251億 最低 +0.012% 平均 +0.037% 按分 20.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/12/11	1,500億 応札 1,511億 落札 1,500億 最低 -0.016% 平均 +0.063% 按分 89.0%
(11:50) 国債補完供給	23/12/ 8-23/12/11	応札 37,703億 落札 37,703億 全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/12/ 8-23/12/11	応札 0億 落札 0億

<12月8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)	成長基盤強化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基金供給	
97,515	10,515	成長基盤強化支援基金供給	1,001	
12/ 6~12/19 6,294.	12/ 5(1-3Y) 3,751.	35,651	776,646	2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	12/ 5(3-5Y) 4,506.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	12/16~12/15 20,601.	5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	12/ 5(10-25Y) 1,505.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	3/18~ 3/18 41,458.	8/19~ 8/19 381.
1/10~ 1/10 20,011.	12/ 5(25Y-) 753.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18~11/18 93.
1/13~ 1/14 20,008.	(12/11(1-3Y) 3,750.)	12/ 2~12/ 2 1,712.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.
1/16~ 1/16 20,009.	(12/11(3-5Y) 4,505.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	※直近約1年分の期落ち分を記載	5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.	(12/11(5-10Y) 5,251.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	米ドル資金供給オペ	8/18~ 8/18 0.
	(12/11(10-25Y) 1,500.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	2百万ドル	11/17~11/17 0.
		12/ 1~12/ 1 2,464.	12/ 7~12/14 2.	
		※直近約1年分の期落ち分を記載		
		成長基盤強化支援基金特別		気候変動対応支援基金供給
		16,426百万ドル		62,659
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.		1/30~ 1/30 28,261.
		6/ 2~ 6/ 3 5,566.		7/21~ 7/19 34,398.
		9/ 5~ 9/ 5 5,382.		
		12/ 4~12/ 4 3,325.		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売入先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債短期証券買入額(月初末)		
		国債売入先オペ		
		0	12/ 6	1,001
		※直近約1週間の実施分を記載		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		国債補完供給		
		37,703		
		12/ 8-12/11 37,703.		
		12/ 8-12/11 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		
		C P買入額(月初末)		
		0		
		(12/12 3,985.)		
		社債買入額(月初末)		
		0		
<12月8日 日銀信用概算(除く買切)>				
共通担保(全)固定	97,515	CP等買入(推定)	24,300	
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	62,700	
国債買入先	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	30,589	手形売出	0	
貸出増加支援	702,255	国債売入先	0	
供給オペ合計	964,043	国債補完供給	37,703	
貸出(推定)	0	国債売入先	0	
供給額合計	964,043	吸収額合計	37,703	
		差し引き	926,340	

※成長基盤強化支援基金供給の各オペは、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8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 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M -----	6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020	3M +0.100000	1Y 買気配 -0.050
1M 売気配 -0.020		

<12月7日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	191,806	-1,871
有担保	28,873	+1,204
無担保	162,933	-3,075

<12月8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	-0.080	0.001	-0.010	± 0					-0.082	-0.002
トムネ				-----					-0.085	+0.003
スポネ				-----						
1週間物	-0.040	0.008	-0.013	-0.007					-0.111	± 0
2週間物			-0.025	-----					-0.123	+0.003
3週間物			-0.013	+0.002					-0.158	-0.022
1ヶ月物	0.020	0.150	0.107	-----					-0.171	+0.002
3ヶ月物				-----					-0.159	+0.007
6ヶ月物				-----					-0.119	-0.001
1年物				-----					-0.078	± 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