

東京短資デイリーレポート

2023/12/11

<12月8日のマネタリーベース>

6,560,600

<12月11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	5,333,600
前日の日銀当座預金残高-①	5,295,900
日銀当座預金残高増減前日比	+37,700

<12月11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		-1,100
財政等要因		-13,400
資金過不足		-14,500
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+14,800
国債補完供給	+37,200	-36,400
金融調節合計		+15,600
当座預金増減-②		+1,100

<12月11日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,297,000
準備預金残高	4,636,900
積み終了先	4,636,200
超過準備	4,636,200
非準備先残高	660,100

<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)	1,000
残り要積立額(平均)	200
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	86.7
進捗率乖離幅	+13.2

<12月12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		-1,400
財政等要因		+4,800
資金過不足		+3,400
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-500	+4,000
国債補完供給	+36,400	
金融調節合計		+39,900
当座預金増減		+43,300

<12月12日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残534兆300億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.010% での合いが中心か。

<12月12日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,385,300	+88,300
+40,000	5,380,300	+83,300
+35,000	5,375,300	+78,300
+30,000	5,370,300	+73,300
+25,000	5,365,300	+68,300
+20,000	5,360,300	+63,300
+15,000	5,355,300	+58,300
+10,000	5,350,300	+53,300
+5,000	5,345,300	+48,300
±0	5,340,300	+43,300
-5,000	5,335,300	+38,300
-10,000	5,330,300	+33,300
-15,000	5,325,300	+28,300
-20,000	5,320,300	+23,300
-25,000	5,315,300	+18,300
-30,000	5,310,300	+13,300
-35,000	5,305,300	+8,300
-40,000	5,300,300	+3,300
-45,000	5,295,300	-1,700

<12月11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。

(11:50) 国債補完供給	23/12/11-23/12/12	応札 36,955億 落札 36,955億 全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/12/11-23/12/12	応札 49億 落札 49億 全取 -0.350% 平均 -0.350%

<12月11日 各オペ残高と内訳>

共通担保(全店)固定金利		国債買入額(月初来)		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				
97,515	25,521	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	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.			
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	12/ 5(10-25Y)	1,505.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	3/18~ 3/18	41,458.			
1/10~ 1/10	20,011.	12/ 5(25Y-)	753.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	6/19~ 6/19	63,179.			
1/13~ 1/14	20,008.	12/11(1-3Y)	3,750.	12/ 2~12/ 2	1,712.	9/16~ 9/13	132,310.			
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				
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	11/17~11/17	0.		
		12/11(10-25Y)	1,500.	9/ 1~ 9/ 1	5,024.	2百万ドル				
				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				
						成長基盤強化支援米ドル特別				
						16,426百万ドル				
						3/ 3~ 3/ 4	2,153.			
						6/ 2~ 6/ 3	5,566.			
						9/ 5~ 9/ 5	5,382.			
						12/ 4~12/ 4	3,325.			
						国債買現先オペ				
						0	国債売現先(米ドルオペ用担保)			
							0			
							国庫短期証券買入額(月初来)			
							国債売現先オペ	1,001		
							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)(月初来)			
							0			
							国債補完供給			
							37,004			
							12/11~12/12	36,955.		
							12/11~12/12	49.		
							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(月初来)			
							0			
							(12/12	3,985.)		
							社債買入額(月初来)			
							0			
							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	30,589	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	964,043	国債補完供給	37,004
							貸出(推定)	0	国債売現先	0
							供給額合計	964,043	吸収額合計	37,004
							差し引き	927,039		

※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11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 -0.130
1M	売気配 -0.020				

<12月8日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	192,068	+262
有担保	29,873	+1,000
無担保	162,195	-738

<12月11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	-0.011	-0.001					-0.086	-0.004
トムネ									-0.086	-0.001
スポネ										
1週間物	-0.040	-0.015	-0.028	-0.015					-0.110	+0.001
2週間物									-0.121	+0.002
3週間物									-0.169	-0.011
1ヶ月物									-0.168	+0.003
3ヶ月物			0.035						-0.155	+0.004
6ヶ月物									-0.115	+0.004
1年物									-0.076	+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