

東京短資デイリーレポート

2023/12/12

<12月11日のマネタリーベース>

6,562,800

<12月12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	5,340,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,297,000
日銀当座預金残高増減前日比	+43,300

<12月12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		-1,500
財政等要因		+4,400
資金過不足		+2,900
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-500	+4,000
国債補完供給	+36,400	-37,700
金融調節合計		+2,200
当座預金増減-②		+5,100

<12月12日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,302,100
準備預金残高	4,671,200
積み終了先	4,670,900
超過準備	4,670,800
非準備先残高	630,900

<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)	600
残り要積立額(平均)	200
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	90.0
進捗率乖離幅	+9.9

<12月13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		-1,600
財政等要因		-17,500
資金過不足		-19,100
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-200	
国債補完供給	+37,700	
金融調節合計		+37,500
当座預金増減		+18,400

<12月13日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残532兆500億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.010% での合いが中心か。

<12月13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	5,365,500	+63,400
+40,000	5,360,500	+58,400
+35,000	5,355,500	+53,400
+30,000	5,350,500	+48,400
+25,000	5,345,500	+43,400
+20,000	5,340,500	+38,400
+15,000	5,335,500	+33,400
+10,000	5,330,500	+28,400
+5,000	5,325,500	+23,400
±0	5,320,500	+18,400
-5,000	5,315,500	+13,400
-10,000	5,310,500	+8,400
-15,000	5,305,500	+3,400
-20,000	5,300,500	-1,600
-25,000	5,295,500	-6,600
-30,000	5,290,500	-11,600
-35,000	5,285,500	-16,600
-40,000	5,280,500	-21,600
-45,000	5,275,500	-26,600

<12月12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) 米ドル資金供給	23/12/14-23/12/21	応札 1m1 落札 1m1	貸付 5.580%
(11:50) 国債補完供給	23/12/12-23/12/13	応札 38,158億 落札 38,158億 全取 -0.350% 平均 -0.351%	
(13:50) 国債補完供給	23/12/12-23/12/13	応札 1億 落札 1億 全取 -0.350% 平均 -0.350%	
(14:45) 米ドルオペ用担保供給	23/12/13-23/12/22	5,000億 応札 2億 落札 2億 全取 -0.100% 平均 -0.100%	

<12月12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
9,7515	25,521	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
12/ 6~12/19 6,294.	12/ 5(1-3Y) 3,751.	35,651	776,646
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
	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.
			(12/14~12/21 1.)
			※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
			(12/13~12/22 2.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			国債売現先オペ
			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)(月初来)
			0
			CP買入額(月初来)
			3,985
			12/12 3,985.
			社債買入額(月初来)
			0
			<12月12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) 27,700
			共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 62,700
			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 手形売切 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 38,159
			貸出(推定) 0 国債現(米ドル担保) 0
			供給額合計 964,043 吸収額合計 38,159
			差し引き 925,884

※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12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 +0.005000	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M +0.010000	6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020	3M +0.050000	1Y 買気配 -0.050
1M 売気配 -0.020		

<12月11日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	183,645	-8,423
有担保	27,719	-2,154
無担保	155,926	-6,269

<12月12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	-0.065	0.001	-0.010	+0.001					-0.085	+0.001
トムネ				-----					-0.086	±0
スポネ				-----						
1週間物	-0.025	-0.013	-0.023	+0.005					-0.107	+0.003
2週間物			-0.020	-----					-0.122	-0.001
3週間物				-----					-0.171	-0.002
1ヶ月物				-----					-0.169	-0.001
3ヶ月物				-----					-0.153	+0.002
6ヶ月物				-----					-0.112	+0.003
1年物				-----					-0.076	±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