

東京短資デイリーレポート

2023/12/25

<12月22日のマネタリーベース>

6,733,100

<12月25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	5,488,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,448,600
日銀当座預金残高増減前日比	+39,700

<12月25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		-2,400
財政等要因		+7,500
資金過不足		+5,100
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-400	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+35,700	-35,700
金融調節合計		-500
当座預金増減-②		+4,600

<12月25日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,453,200
準備預金残高	4,744,100
積み終了先	4,742,500
超過準備	4,742,500
非準備先残高	709,100

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,969,100
今積み期間所要準備額 (平均)	128,000
残り要積立額 (積数)	19,300
残り要積立額 (平均)	900
準備進捗率(%)	99.5
日数進捗率(%)	32.3
進捗率乖離幅	+67.2

<12月26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		-2,500
財政等要因		-1,000
資金過不足		-3,500
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+12,200
CP等買入	-700	
国債補完供給	+35,700	
金融調節合計		+47,200
当座預金増減		+43,700

<12月26日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残549兆6,900億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。

<12月26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	5,541,900	+88,700
+40,000	5,536,900	+83,700
+35,000	5,531,900	+78,700
+30,000	5,526,900	+73,700
+25,000	5,521,900	+68,700
+20,000	5,516,900	+63,700
+15,000	5,511,900	+58,700
+10,000	5,506,900	+53,700
+5,000	5,501,900	+48,700
± 0	5,496,900	+43,700
-5,000	5,491,900	+38,700
-10,000	5,486,900	+33,700
-15,000	5,481,900	+28,700
-20,000	5,476,900	+23,700
-25,000	5,471,900	+18,700
-30,000	5,466,900	+13,700
-35,000	5,461,900	+8,700
-40,000	5,456,900	+3,700
-45,000	5,451,900	-1,300

<12月25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(3Y-5Y)	23/12/26	4,250億	応札 8,075億	落札 4,253億	最低 -0.040%	平均 -0.033%	按分 71.6%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/12/26	4,750億	応札 11,025億	落札 4,751億	最低 -0.054%	平均 -0.044%	按分 74.3%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/12/26	1,500億	応札 5,856億	落札 1,504億	最低 -0.046%	平均 -0.042%	按分 50.7%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/12/26	750億	応札 2,546億	落札 751億	最低 -0.060%	平均 -0.049%	按分 77.0%
(10:10) 国債買入(物国)	23/12/26	600億	応札 2,231億	落札 600億	按分 -0.030%	平均 -0.236%	按分 56.0%
(11:50) 国債補完供給	23/12/25-23/12/26		応札 35,990億	落札 35,990億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(13:50) 国債補完供給	23/12/25-23/12/26		応札 0億	落札 0億			

<12月25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)		成長基盤強化支援資金供給		貸出増加支援資金供給		被災地金融機関支援資金供給	
103,843		51,793		16,426	百万ドル	807,139		1,001	
12/19~ 1/10	12,622.	12/19(1-3Y)	3,752.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	3/18~ 3/18	41,458.	2/18~ 2/16	0.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	12/19(3-5Y)	4,501.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	6/19~ 6/19	63,179.	5/17~ 5/17	0.
1/ 5~ 1/ 6	20,016.	12/19(5-10Y)	5,252.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	9/16~ 9/13	132,310.	8/19~ 8/19	381.
1/10~ 1/10	20,011.	12/19(10-25Y)	1,502.	12/ 2~12/ 2	1,712.	12/15~12/13	54,701.	11/18~11/18	93.
1/13~ 1/14	20,008.	(12/26(3-5Y)	4,253.)	3/ 3~ 3/ 3	6,793.			2/17~ 2/17	346.
1/16~ 1/16	20,009.	(12/26(5-10Y)	4,751.)	6/ 2~ 6/ 2	2,644.			5/12~ 5/12	181.
1/19~ 1/20	1,163.	(12/26(10-25Y)	1,504.)	9/ 1~ 9/ 1	5,024.			8/18~ 8/18	0.
		(12/26(25Y-)	751.)	12/ 1~12/ 1	2,464.			11/17~11/17	0.
		(12/26(物国)	600.)						
共通担保(全店)金利入札		国債買入額(月初末)		成長基盤強化支援資金供給		貸出増加支援資金供給		被災地金融機関支援資金供給	
70,035		0		16,426	百万ドル	807,139		1,001	
1/24~ 1/24	10,003.			3/ 3~ 3/ 4	2,153.				
2/ 1~ 2/ 1	10,004.			6/ 2~ 6/ 3	5,566.				
2/15~ 2/15	10,004.			9/ 5~ 9/ 5	5,382.				
3/ 1~ 3/ 1	10,010.			12/ 4~12/ 4	3,325.				
9/15~ 9/15	10,005.								
10/10~10/10	10,006.								
10/25~10/25	10,003.								
国債補完供給		国債買入額(固定利回)(月初末)		国債買入額(固定利回)(月初末)		国債買入額(固定利回)(月初末)		国債買入額(固定利回)(月初末)	
35,990		0		0		0		0	
12/25-12/26	35,990.								
12/25-12/26	0.								
ETF買入額		ETF買入額(企業支援)		ETF買入額(企業支援)		ETF買入額(企業支援)		ETF買入額(企業支援)	
356,921		14,628		14,628		14,628		14,628	
約定 23/10/ 4	701.	約定 21/ 3/31	12.	約定 21/ 3/31	12.	約定 21/ 3/31	12.	約定 21/ 3/31	12.
J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額	
6,823		6,823		6,823		6,823		6,823	
約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6/14	12.
C/P買入額(月初末)		C/P買入額(月初末)		C/P買入額(月初末)		C/P買入額(月初末)		C/P買入額(月初末)	
3,985		3,985		3,985		3,985		3,985	
12/12	3,985.	12/12	3,985.	12/12	3,985.	12/12	3,985.	12/12	3,985.
社債買入額(月初末)		社債買入額(月初末)		社債買入額(月初末)		社債買入額(月初末)		社債買入額(月初末)	
1,000		1,000		1,000		1,000		1,000	
12/19	1,000.	12/19	1,000.	12/19	1,000.	12/19	1,000.	12/19	1,000.
国債買入先オペ		国債買入先オペ		国債買入先オペ		国債買入先オペ		国債買入先オペ	
0		0		0		0		0	
国債売先オペ		国債売先オペ		国債売先オペ		国債売先オペ		国債売先オペ	
0		0		0		0		0	
国債売先オペ(米ドルオペ用担保)		国債売先オペ(米ドルオペ用担保)		国債売先オペ(米ドルオペ用担保)		国債売先オペ(米ドルオペ用担保)		国債売先オペ(米ドルオペ用担保)	
0		0		0		0		0	
国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)	
1,001		1,001		1,001		1,001		1,001	
12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.
米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ	
2百万ドル		2百万ドル		2百万ドル		2百万ドル		2百万ドル	
12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.
気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給	
62,659		62,659		62,659		62,659		62,659	
1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.
7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.
国債買入先オペ		国債買入先オペ		国債買入先オペ		国債買入先オペ		国債買入先オペ	
0		0		0		0		0	
国債売先オペ		国債売先オペ		国債売先オペ		国債売先オペ		国債売先オペ	
0		0		0		0		0	
国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)		国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)		国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)		国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)		国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)	
0		0		0		0		0	
国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)	
1,001		1,001		1,001		1,001		1,001	
12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.
米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ	
2百万ドル		2百万ドル		2百万ドル		2百万ドル		2百万ドル	
12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.
気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給	
62,659		62,659		62,659		62,659		62,659	
1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.
7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.
ETF買入額		ETF買入額		ETF買入額		ETF買入額		ETF買入額	
356,921		356,921		356,921		356,921		356,921	
約定 23/10/ 4	701.	約定 21/ 3/31	12.	約定 21/ 3/31	12.	約定 21/ 3/31	12.	約定 21/ 3/31	12.
J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額	
6,823		6,823		6,823		6,823		6,823	
約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6/14	12.
C/P買入額(月初末)		C/P買入額(月初末)		C/P買入額(月初末)		C/P買入額(月初末)		C/P買入額(月初末)	
3,985		3,985		3,985		3,985		3,985	
12/12	3,985.	12/12	3,985.	12/12	3,985.	12/12	3,985.	12/12	3,985.
社債買入額(月初末)		社債買入額(月初末)		社債買入額(月初末)		社債買入額(月初末)		社債買入額(月初末)	
1,000		1,000		1,000		1,000		1,000	
12/19	1,000.	12/19	1,000.	12/19	1,000.	12/19	1,000.	12/19	1,000.
国債買入先オペ		国債買入先オペ		国債買入先オペ		国債買入先オペ		国債買入先オペ	
0		0		0		0		0	
国債売先オペ		国債売先オペ		国債売先オペ		国債売先オペ		国債売先オペ	
0		0		0		0		0	
国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)		国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)		国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)		国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)		国債買入先オペ(米ドルオペ用担保)	
0		0		0		0		0	
国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)		国債短期証券買入額(月初末)	
1,001		1,001		1,001		1,001		1,001	
12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.	12/ 6	1,001.
米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ		米ドル資金供給オペ	
2百万ドル		2百万ドル		2百万ドル		2百万ドル		2百万ドル	
12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.	12/21-12/28	2.
気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給		気候変動対応支援資金供給	
62,659		62,659		62,659		62,659		62,659	
1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.	1/30~ 1/30	28,261.
7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.	7/21~ 7/19	34,398.
ETF買入額		ETF買入額		ETF買入額		ETF買入額		ETF買入額	
356,921		356,921		356,921		356,921		356,921	
約定 23/10/ 4	701.	約定 21/ 3/31	12.	約定 21/ 3/31	12.	約定 21/ 3/31	12.	約定 21/ 3/31	12.
J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額	
6,823		6,823		6,823		6,823		6,823	
約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6/14	12.	約定 22/ 6					