

東京短資デイリーレポート

2023/12/29

<12月28日のマネタリーベース>

6,734,900

<12月29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	5,480,800	
前日の日銀当座預金残高①	5,440,900	
日銀当座預金残高増減前日比	+39,900	

<12月29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		+300
財政等要因		-9,700
資金過不足		-9,400
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-2,900	+4,000
国債補完供給	+46,000	-41,800
金融調節合計		+5,300
当座預金増減②		-4,100

<12月29日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,436,800
準備預金残高	4,734,900
積み終了先	4,734,100
超過準備	4,732,900
非準備先残高	701,900

<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)	2,700
残り要積立額(平均)	200
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	61.3
進捗率乖離幅	+38.6

<1月4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		+2,300
財政等要因		-10,800
資金過不足		-8,500
金融調節確定分		
	期落	新規
国債補完供給	+41,800	
金融調節合計		+41,800
当座預金増減		+33,300

<1月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆100億円)で 無担保コール0/Nは-0.030%~-0.015% での出合いが中心か。
--

<1月4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	5,515,100	+78,300
+40,000	5,510,100	+73,300
+35,000	5,505,100	+68,300
+30,000	5,500,100	+63,300
+25,000	5,495,100	+58,300
+20,000	5,490,100	+53,300
+15,000	5,485,100	+48,300
+10,000	5,480,100	+43,300
+5,000	5,475,100	+38,300
±0	5,470,100	+33,300
-5,000	5,465,100	+28,300
-10,000	5,460,100	+23,300
-15,000	5,455,100	+18,300
-20,000	5,450,100	+13,300
-25,000	5,445,100	+8,300
-30,000	5,440,100	+3,300
-35,000	5,435,100	-1,700
-40,000	5,430,100	-6,700
-45,000	5,425,100	-11,700

<12月29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	23/12/29-24/ 1/ 4	応札 41,990億 落札 41,990億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	23/12/29-24/ 1/ 4	応札 0億 落札 0億

<12月29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
103,843	63,652	1,001	1,001
12/19~ 1/10 12,622.	12/26(3-5Y) 4,253.	35,651	807,139
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	12/26(5-10Y) 4,751.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	12/26(10-25Y) 1,504.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/10~ 1/10 20,011.	12/26(25Y-) 751.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/13~ 1/14 20,008.	12/26(物国) 600.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.
1/16~ 1/16 20,009.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	
1/19~ 1/20 1,163.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	
		12/ 1~12/ 1 2,464.	
		※直近約1年分の期落ち分を記載 米ドル資金供給オペ 0百万ドル	
		12/28~ 1/11 0.	
		※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(月初末) 国債売現先オペ 2,001	
		12/ 6 1,001.	
		12/27 1,000.	
		CP買入額(月初末) 7,975	
		12/12 3,985.	
		12/29 3,990.	
		社債買入額(月初末) 1,000	
		12/19 1,000.	
		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	
		国債補完供給 41,990	
		12/29~ 1/ 4 41,990.	
		12/29~ 1/ 4 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	

※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29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アウトライイト
S/N	0.000	1M +0.080000	3M 買気配 -0.150
1W	売気配 -0.020	2M +0.028000	6M 買気配 -0.150
2W	売気配 -0.020	3M +0.090000	1Y 買気配 -0.150
1M	売気配 -0.020		

<12月28日のJ-レ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	202,268	-3,634
有担保	27,458	+719
無担保	174,810	-4,353

<12月29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	-0.039	-0.023					-0.087	+0.009
トムネ			-0.038	-0.013					-0.108	+0.021
スポネ										
1週間物	-0.032	-0.010	-0.024	+0.005					-0.136	+0.031
2週間物									-0.140	+0.017
3週間物									-0.144	+0.015
1ヶ月物	-0.025	-0.010	-0.015	-0.012					-0.146	+0.011
3ヶ月物									-0.147	+0.003
6ヶ月物									-0.097	+0.005
1年物									-0.063	+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