

東京短資デイリーレポート

2024/11/7

<11月6日のマネタリーベース>

6,723,100

<11月7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	5,495,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,480,200
日銀当座預金残高増減前日比	+14,900

<11月7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	0
財政等要因	-3,700
資金過不足	-3,700
金融調節	
国債買入	期落 新規
CP等買入	-100
国債補完供給	+9,300 -7,900
金融調節合計	+10,000
当座預金増減-②	+6,300

<11月7日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,486,500
準備預金残高	4,916,500
積み終了先	4,916,400
超過準備	4,916,400
非準備先残高	570,000

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,035,500
今積み期間所要準備額 (平均)	130,200
残り要積立額 (積数)	300
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	74.2
進捗率乖離幅	+25.7

<11月8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	+200
財政等要因	-22,400
資金過不足	-22,200
金融調節確定分	
CP等買入	期落 新規
国債補完供給	-600 +7,900
金融調節合計	+7,300
当座預金増減	-14,900

<11月8日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆1,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<11月8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	5,516,600	+30,100
+40,000	5,511,600	+25,100
+35,000	5,506,600	+20,100
+30,000	5,501,600	+15,100
+25,000	5,496,600	+10,100
+20,000	5,491,600	+5,100
+15,000	5,486,600	+100
+10,000	5,481,600	-4,900
+5,000	5,476,600	-9,900
±0	5,471,600	-14,900
-5,000	5,466,600	-19,900
-10,000	5,461,600	-24,900
-15,000	5,456,600	-29,900
-20,000	5,451,600	-34,900
-25,000	5,446,600	-39,900
-30,000	5,441,600	-44,900
-35,000	5,436,600	-49,900
-40,000	5,431,600	-54,900
-45,000	5,426,600	-59,900

<11月7日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/11/ 7-24/11/ 8	応札 8,090億 落札 8,090億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/11/ 7-24/11/ 8	応札 0億 落札 0億

<11月7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
9,228	8,763	29,719	857,802	899
10/30~11/13 8,007.	11/ 7(-1Y) 1,502.	12/ 2-12/ 2 1,712.	12/15-12/13 54,701.	11/18-11/18 93.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	11/ 7(1-3Y) 3,255.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	2/17~ 2/17 346.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	11/ 7(3-5Y) 3,255.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/17~ 5/12 0.
1/10~ 1/10 20,011.	11/ 7(25Y-) 751.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.		12/ 1-12/ 1 2,464.		8/19~ 8/18 279.
1/16~ 1/16 20,009.		3/ 2~ 3/ 2 7,922.		8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.		6/ 3~ 6/ 3 3,160.		11/17-11/17 0.
		12/ 4-12/ 4 3,325.		2/16~ 2/16 0.
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			1百万ドル	
			11/ 7-11/14 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	
			12,401百万ドル	
			12/ 4-12/ 4 3,325.	
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
			6/ 3~ 6/ 3 5,318.	
			9/ 5~ 9/ 5 1,661.	
			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)	
			0	
			国債売現先オペ	
			0	
			※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	
			8,090	
			11/ 7-11/ 8 8,090.	
			11/ 7-11/ 8 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	
			社債買入額(月初末)	
			0	

<11月7日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	99,228	CP等買入(推定)	18,600
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	53,500
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	899		
気候変動対応支援	119,626		
成長基盤支援	25,566	手形売出	0
貸出増加支援	783,814	国債売現先	0
供給オペ合計	1,099,168	国債補完供給	8,090
貸出(推定)	0	国債売(米ドル担保)	0
供給額合計	1,099,168	吸収額合計	8,090
		差し引き	1,091,078

※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。

<11月7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	+0.200	1M	+0.268000	3M	買気配 +0.050
1W	売気配 +0.200	2M	-----	6M	買気配 +0.230
2W	売気配 +0.200	3M	-----	1Y	買気配 +0.350
1M	売気配 +0.200				

<11月6日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	119,819	-261
有担保	36,888	-499
無担保	82,931	+238

<11月7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	0.220	0.228	0.227	±0				-----	0.226	-0.014
トムネ				-----				-----	0.231	-0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.204	±0
2週間物	0.275	0.280	0.278	+0.042				-----	0.204	±0
3週間物				-----				-----	0.204	±0
1ヶ月物			0.290	+0.010				-----	0.207	±0
3ヶ月物				-----				-----	0.243	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.308	+0.006
1年物				-----				-----	0.359	+0.003

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